



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Novembro/2024

1. INTRODUÇÃO

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pela EMBRAER PREV, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador, referentes aos riscos de mercado, de crédito, operacionais, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência.

Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV, bem como na Resolução CMN Nº 4.994/2022.

2. RISCO DE MERCADO

Para o acompanhamento do risco de mercado da carteira de investimentos da EMBRAER PREV, a Entidade adotará a metodologia de avaliação de risco conhecida como o Valor em Risco (*VaR*), que indica a probabilidade de perda de uma carteira de investimentos para um determinado intervalo de confiança e prazo. O intervalo de confiança e prazos a serem utilizados serão definidos em Política de Investimento. Quando não houver essa definição, a Entidade deverá usar um intervalo de confiança de 95% e prazo de 21 dias úteis (um mês). O *VaR* poderá ser calculado de forma absoluta ou relativa. Para as carteiras de renda variável o *tracking error (TE)* pode ser empregado como uma alternativa ao *VaR*. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle de risco de mercado:

2.1 Relatório Detalhado de Risco

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



Data: 29/11/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS**
CNPJ: **10679245000140**

Dados Gerais		Limites		ENQUADRADO		0,00% Duration DC:		2.211,31	
PL:	4.961.716.012,05	VAR / PL:	0,8253%	Limite Fundo:	0,00	Duration DC:	0,00	2.211,31	
VAR:	40.947.060,72	ETL / PL:	1,0349%	Status:	0,00	Duration DU:	0,00	1.515,44	
ETL:	51.349.266,09	VAR / CDI:	0,0091%	Benchmark:					

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	125.126.418,35	Cenário Baixa - 10000 (+):	154.699.491,98	CENARIO BRADESCO 1 (+):	317.434.525,74	CENARIO BRADESCO 2 (+):	621.683.052,01			
Cenário Alta - 09999 (-):	-202.634.399,80	Cenário Baixa - 10000 (-):	-124.236.580,20	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-68.182.927,16	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-895.184.675,59			
Cenário Alta - 09999:	-77.507.981,45	Cenário Baixa - 10000:	30.462.911,78	CENARIO BRADESCO 1:	249.251.598,59	CENARIO BRADESCO 2:	-273.501.623,59			

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ONCO3	35.534,00	14.557,34	-2.394,53	-0,01%	531.940,50	-531.940,50	155.964,96	-157.241,61
OULG11	1.063.881,00	37.924,59	-21.396,28	-0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-263,06	242,50	509,65	-749,80
OVS10	1.838.613,30	49,36	17,92	0,00%	-1.716,70	1.532,62	2.911,23	-3.997,21
OVS10A8	698.100,22	329,14	212,05	0,00%	-250,43	24,81	93,72	-122,71
PASN12	4.301,46	49,77	1,35	0,00%	2.100.524,80	-2.100.524,80	615.873,87	-620.915,13
PATG11	4.201.049,60	218.858,54	101.959,91	0,25%	4.659,93	-4.470,76	1.834,88	-1.849,30
PCAR3	12.516,24	2.606,64	-836,23	0,00%	657.258,55	-920.196,32	429.225,18	-432.738,62
PETR3	2.927.866,14	283.877,12	141.638,88	0,35%	3.193.042,16	-4.064.866,63	1.950.103,27	-1.966.065,91
PETRA	13.302.205,10	1.190.448,56	608.483,19	1,49%	5.454,57	-8.767,60	2.433,27	-2.453,18
PETZ3	16.598,00	3.228,32	370,48	0,00%	8.360.002,93	-5.654.172,88	2.429.472,81	-2.449.359,35
PRIO3	16.572.120,12	1.210.687,02	186.905,28	0,46%	2.500.252,55	-2.569.865,15	748.381,86	-754.507,77
QAGR11	5.104.924,00	118.182,96	12.556,68	0,03%	376,57	763,03	208,46	-282,86
QUAT12	3.311.228,83	4.981,36	123,85	0,00%	351.732,86	-287.852,54	229.725,63	-231.606,05
RADL3	1.567.023,36	118.430,51	59.530,78	0,15%	-1.045.790,46	-4.734,55	529.567,97	-650.631,52
RAHD11	8.900.617,12	143.347,67	108.838,65	0,27%	6.991.210,71	-5.168.631,22	2.288.957,23	-2.307.693,58
RAIL3	15.613.623,65	1.848.276,46	725.144,24	1,77%	19.123,58	-23.412,98	9.222,78	-9.298,28
RAI24	62.911,20	7.546,59	363,36	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBKAPMZ	4.672.538,95	7.129,67	-950,39	0,00%	932.474,99	-888.568,41	263.746,61	-265.905,52
RBPR11	1.799.090,11	165.324,90	83.230,02	0,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
RCRB11	5.404.588,00	200.115,01	-75.142,30	-0,18%	-851,56	777,37	1.586,72	-2.310,69
RDCO10	3.850.728,19	160,33	63,66	0,00%	890.868,64	-818.102,24	412.224,78	-415.599,06
RDR3	2.811.901,60	312.256,76	150.638,60	0,37%	-3.736,47	3.316,87	6.259,46	-8.244,86
RDRB9	1.112.589,16	698,03	510,49	0,00%	-5.343,15	4.743,13	8.951,02	-11.790,15
RDR09	1.591.002,50	998,18	730,00	0,00%	-304.205,23	-3.509,76	147.668,61	-184.374,84
RDVE11	3.081.661,46	43.148,60	27.794,30	0,07%	281.596,98	-302.011,26	72.793,84	-73.389,70
RECV3	496.547,34	63.871,00	29.753,12	0,07%	4.248.617,06	-2.592.578,08	1.637.970,61	-1.651.378,29
RENT3	11.173.060,12	872.185,68	80.224,90	0,20%	-303.589,71	-37.429,10	126.291,85	-160.447,73
RIS412	2.719.621,23	36.388,55	26.808,66	0,07%	-1.170.612,16	-3.698,28	617.406,43	-745.084,98
RMSA12	7.857.210,75	159.225,31	138.930,97	0,34%	-14.005,48	12.444,81	23.530,23	-31.567,05
RODB11	2.749.956,55	2.636,69	1.841,00	0,00%	-126,62	122,53	268,17	-398,53
RSAN24	1.847.012,16	21,92	6,43	0,00%	57.415,05	-55.110,99	42.391,31	-42.738,30
SANB11	289.163,07	32.494,91	2.091,77	0,01%	532.062,42	-574.872,04	165.414,54	-166.768,54
SARE11	1.128.339,27	67.805,46	-34.374,25	-0,08%	203.120,37	-206.001,00	76.336,53	-76.961,38
SBF63	520.713,00	77.727,43	51.673,32	0,13%	1.749.127,03	-1.610.384,05	974.838,79	-982.818,37
SBP3	6.649.650,66	493.577,54	307.155,54	0,75%	-49.580,82	9.022,11	8.669,11	-11.751,39
SBP3P7	2.437.755,88	401,85	206,76	0,00%	-2.082,85	1.869,00	3.664,12	-5.213,58
SCAR3	121.481,00	6.198,21	3.956,36	0,01%	70.528,60	-73.478,60	17.809,12	-17.954,89
SLCE3	26.306,51	1.171,00	-97,45	0,00%	8.108,03	-7.775,61	3.856,53	-3.888,10
SMFT3	4.766.352,00	622.075,52	-13.619,91	-0,03%	1.961.476,80	-1.882.996,80	698.747,20	-704.466,83
SMT03	104.419,40	5.739,43	113,19	0,00%	28.867,44	-32.649,97	15.307,88	-15.433,19
SNGO18	836.690,28	6,90	2,32	0,00%	-41,88	41,15	93,54	-139,61
SRNA3	500.383,00	94.411,18	-17.565,99	-0,04%	0,00	0,00	73.356,15	-73.956,61
STBP3	566.220,94	79.942,13	24.813,12	0,06%	198.773,58	-197.890,24	83.007,99	-83.687,46
SUZB3	12.305.592,00	862.364,17	-74.480,51	-0,18%	2.861.937,56	-2.598.373,08	1.803.999,79	-1.818.766,50
TAE11	80.350,13	2.357,58	1.056,29	0,00%	18.614,41	-20.971,41	11.779,33	-11.875,75
TBSP11	2.314.223,00	315,67	172,52	0,00%	-1.650,29	1.485,27	2.909,79	-4.117,99
TCI11	4.792.337,20	77.585,11	61.272,26	0,15%	-583.544,06	-7.980,78	295.498,15	-360.556,35
TIMS3	1.075.773,60	106.054,24	28.479,01	0,07%	318.249,69	-262.593,35	157.708,41	-158.999,34
TOTS3	1.117.402,32	121.907,81	28.995,44	0,07%	226.898,59	-221.201,71	163.811,18	-165.152,06
UGPA3	10.399.028,64	1.205.361,68	-33.588,52	-0,08%	1.983.872,66	-2.473.971,81	1.524.497,60	-1.536.976,43
UNEG11	7.448.310,01	141.773,45	119.199,91	0,29%	-960.828,56	39.416,41	522.622,35	-638.358,41
USIM5	73.170,38	6.152,36	-1.689,53	0,00%	27.211,28	-16.841,10	10.726,78	-10.814,58
VALE3	19.001.399,14	1.803.995,43	-169.741,98	-0,41%	4.245.251,35	-5.053.408,85	2.785.605,11	-2.808.406,79
VAMO22	719.190,57	21,59	8,17	0,00%	-119,38	111,54	235,04	-344,94
VAMO3	62.120,91	10.710,59	1.862,32	0,00%	21.452,64	-24.977,11	9.106,93	-9.181,47
VAMO33	4.097.996,13	43.313,48	30.785,67	0,08%	-431.842,42	-77.565,94	159.801,63	-205.807,39
VAMO34	7.016.834,96	79.886,80	56.759,35	0,14%	-750.671,15	-116.393,97	290.821,37	-373.963,05
VBBR3	5.564.261,71	401.377,58	229.149,47	0,56%	1.300.035,94	-1.445.683,12	615.720,77	-822.397,88
VCCS11	191.255,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VECS11	3.582.916,22	8,57	5,18	0,00%	-33,46	36,72	101,69	-153,38
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	3.446.433,04	42.168,77	4.841,06	0,01%	-265.500,14	-42.490,96	94.124,45	-123.085,25
VIMT13	1.333.300,27	19.270,38	14.364,70	0,04%	-141.480,67	-4.282,21	67.772,49	-84.746,79
VIVA3	42.924,96	5.945,24	1.742,01	0,00%	11.100,96	-13.834,08	6.292,80	-6.344,31
VIVT3	1.954.158,24	191.365,52	20.784,45	0,05%	284.955,10	-299.161,42	286.479,60	-288.824,59
VIXL18	2.396.506,71	1.071,66	729,82	0,00%	-5.656,78	5.035,33	5.929,07	-12.885,26
VSHO11	25.116,00	947,40	599,64	0,00%	12.006,50	-12.741,82	3.682,01	-3.712,15
VVMR11	4.084.340,00	235.628,56	44.788,84	0,11%	0,00	0,00	598.764,24	-603.665,45
VVRT11	2.417.836,96	162,61	79,66	0,00%	-857,87	776,47	1.547,53	-2.216,09
WDOF25	-3.087,46	37.874,83	15.192,38	0,04%	-76.523,31	84.441,63	-104.243,94	104.827,62
WDOZ24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WEGE3	4.335.186,36	504.762,84	-39.514,41	-0,10%	1.115.998,07	-1.304.475,71	723.498,32	-729.424,54
WINZ24	18.357,00	95.572,09	45.690,71	0,11%	374.445,66	-411.256,74	318.340,30	-320.487,53
XPIN11	2.848.593,00	78.579,43	25.106,60	0,06%	1.442.001,00	-1.418.395,00	417.603,73	-421.022,05
XPPR11	2.256.413,94	125.417,59	43.961,64	0,11%	1.130.503,19	-1.127.441,57	330.790,28	-333.497,98
YDUQ3	1.325.839,50	177.835,21	-59.687,77	-0,15%	544.970,20	-316.409,81	194.368,07	-195.959,08
Total Var:	3.036.141.077,63	78.317.465,84	40.947.060,72	99,96%	-77.507.981,45	-30.462.911,78	249.251.598,59	-273.501.623,59

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.306.761,971,03	VAR / PL:	0,8108%
VAR:	34.918.327,69	ETL / PL:	1,0167%
ETL:	43.788.991,65	VAR / CDI:	0,0089%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Dutacion DC:	0,00%	Dutacion DU:	1,571,24
Benchmark:			1,076,49

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	144.642.116,41
Cenário Alta - 09999 (-):	-189.714.222,36	Cenário Baixa - 10000 (-):	-715.924,63
Cenário Alta - 09999:	-189.714.222,36	Cenário Baixa - 10000:	143.926.191,78
CENARIO BRADESCO 1 (+):	190.735.124,15	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-213.419.815,83
CENARIO BRADESCO 1:	190.735.124,15	CENARIO BRADESCO 2:	-213.419.815,83

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CADA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.481.886.826,57	34.362.844,33	34.195.729,14	97,93%	-165.848.644,94	139.029.193,05	176.827.685,77	-196.548.648,41
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	113.407.169,85	889.413,73	-216.795,52	-0,62%	-3.662.782,17	210.972,23	1.551.780,95	-2.040.670,33
FIM EMB II A	245.957.940,01	249.558,53	78.575,23	0,23%	-1.573.001,88	1.759.239,64	1.309.226,81	-1.691.440,08
FIM EMB VI A CRED PRIV	166.397.852,66	1.131.718,39	335.849,14	0,96%	-7.893.780,02	3.642.711,50	6.257.187,80	-7.115.365,58
FIM EMB VII A CRED PRIV	178.042.315,99	1.422.734,83	524.969,70	1,50%	-10.736.013,35	-715.924,63	4.789.242,82	-6.023.691,43
Total Var:	4.163.692.105,08	38.056.329,81	34.918.327,69	100,00%	-189.714.222,36	143.926.191,78	190.735.124,15	-213.419.815,83

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	491.240.414,72	VAR / PL:	4,1381%
VAR:	20.327.937,16	ETL / PL:	5,1893%
ETL:	25.492.053,30	VAR / CDI:	0,0456%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Dutacion DC:	0,00%	Dutacion DU:	3,51
Benchmark:			1,35

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	109.129.653,61	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-108.019.552,74
Cenário Alta - 09999:	109.129.653,61	Cenário Baixa - 10000:	-108.019.552,74
CENARIO BRADESCO 1 (+):	62.058.217,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-62.569.438,43
CENARIO BRADESCO 1:	62.058.217,35	CENARIO BRADESCO 2:	-62.569.438,43

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CADA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA EMB VIII ETF	86.363.164,60	3.760.797,53	3.724.598,38	18,32%	7.348.816,10	-8.020.616,01	6.308.036,09	-6.359.678,72
FIA RVA EMB II	92.945.678,13	3.786.208,43	3.768.321,63	18,53%	22.633.033,59	-23.816.378,39	13.346.777,00	-13.456.069,75
FIA RVA EMB III	102.371.184,42	4.405.587,43	4.198.324,88	20,65%	25.918.739,49	-23.319.902,63	12.845.904,51	-12.954.266,22
FIA RVA EMB IV	94.006.569,99	3.905.920,82	3.862.281,90	19,00%	25.373.576,77	-22.793.667,88	12.921.229,15	-13.027.394,74
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB 1	115.557.452,60	4.841.860,15	4.775.410,36	23,49%	27.855.487,66	-30.068.987,82	16.636.270,60	-16.772.029,00
Total Var:	491.244.049,74	20.700.374,35	20.327.937,16	99,99%	109.129.653,61	-108.019.552,74	62.058.217,35	-62.569.438,43

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



Data: 29/11/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB II				CNPJ:		11005764000196			
Dados Gerais											
PL:	3.525.628.513,59	VAR / PL:	0,9747%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1,725,52				
VAR:	34.362.843,67	ETL / PL:	1,2223%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,182,28				
ETL:	43.092.392,28	VAR / CDI:	0,0107%	Benchmark:							
Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	139.634.914,47	CENARIO BRADESCO 1 (+):	176.827.682,37	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00				
Cenário Alta - 09999 (-):	-165.848.641,76	Cenário Baixa - 10000 (-):	-605.724,09	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-196.548.644,63				
Cenário Alta - 09999:	-165.848.641,76	Cenário Baixa - 10000:	139.029.190,38	CENARIO BRADESCO 1:	176.827.682,37	CENARIO BRADESCO 2:	-196.548.644,63				
Parâmetros do Cálculo											
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA							
Int. Confiança:	95			0,94							
Horizonte:	21										
Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2			
CSMG3	5.650.748,52	18.910,09	-5.249,20	-0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00			
ELET4	14.488.582,27	176.652,70	-29.364,65	-0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00			
ENTV12	14.043.222,37	145.259,23	4.702,36	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00			
GASPI7	50.586.455,64	539.537,26	-110.650,50	-0,32%	-46.278,82	47.199,27	174.546,00	-265.669,07			
IGSN15	2.963.797,61	31.826,24	9.075,89	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00			
NEOF16	7.508.579,28	86.273,82	-9.279,98	-0,03%	-39.954,45	19.707,13	14.414,14	-19.449,80			
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.527.637,69	181.893,49	-45.655,82	-0,13%	0,00	0,00	0,00	0,00			
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.011.601,65	205.656,34	154.558,75	0,45%	-1.190.275,69	-271.391,70	372.889,95	-490.046,68			
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	225.730.395,72	3.232.254,24	3.149.426,27	9,17%	-1.124.075,44	-158.398,92	421.594,61	-548.033,34			
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	28.220.065,44	560.034,08	550.008,08	1,60%	-926.534,72	1.385.468,75	1.052.961,11	-1.389.534,59			
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	210.476.042,51	5.105.966,78	4.936.772,18	14,37%	-240.210,18	-20.921,80	103.087,97	-131.048,82			
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	672.524.432,10	17.079.500,09	17.023.229,17	49,54%	-642.217,01	-155.011,67	197.796,36	-259.763,90			
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	207.007.577,51	5.628.138,82	5.590.484,38	16,27%	-793.108,26	933.914,35	751.853,52	-999.082,07			
SBSPC2	5.159.998,48	12.247,94	-4.302,44	-0,01%	-1.308.414,52	1.188.265,79	1.320.898,49	-1.679.802,27			
BBTOPIMA	82.661.853,33	356.841,26	94.253,12	0,27%	-17.911.066,97	15.407.624,99	18.591.576,84	-22.605.149,13			
BBTOPIND	259.654.770,47	3.241.515,53	3.070.644,89	8,94%	-2.869.368,73	2.459.364,83	2.995.707,24	-3.492.504,81			
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-25.067.653,19	20.899.448,36	26.476.561,62	-29.825.857,55			
COMPROMISSADA PRE	1.626.172.624,79	26.073,15	-15.808,85	-0,05%	-85.421.124,93	73.163.828,18	93.149.574,28	-101.619.504,42			
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-106.825,70	0,00	0,00	0,00%	-28.240.289,37	24.124.985,10	31.199.312,35	-33.216.545,29			
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00			
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-28.069,48	5.107,74	4.907,89	-6.652,88			
Total Var:	3.481.896.759,67	36.628.581,05	34.362.843,67	100,00%	-165.848.641,75	139.029.190,38	176.827.682,37	-196.548.644,63			

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB V CREDITO PRIVADO				CNPJ:		20726178000121			
Dados Gerais											
PL:	112.760.218,36	VAR / PL:	0,7888%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	588,91				
VAR:	889.413,73	ETL / PL:	0,9891%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	402,48				
ETL:	1.115.360,70	VAR / CDI:	0,0087%	Benchmark:							
Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	692.993,30	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.551.780,95	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00				
Cenário Alta - 09999 (-):	-3.662.782,16	Cenário Baixa - 10000 (-):	-482.021,08	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-2.040.670,33				
Cenário Alta - 09999:	-3.662.782,16	Cenário Baixa - 10000:	210.972,23	CENARIO BRADESCO 1:	1.551.780,95	CENARIO BRADESCO 2:	-2.040.670,33				
Parâmetros do Cálculo											
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA							
Int. Confiança:	95			0,94							
Horizonte:	21										
Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2			
17H0164854	6.037.552,91	109.387,99	104.213,80	11,72%	-165.983,73	37.472,40	78.545,24	-104.444,41			
AEGP23	7.588.274,16	36.491,64	23.983,86	2,70%	-72.588,05	63.040,60	38.283,12	-51.644,69			
CMDT33	745.212,31	1.768,86	1.064,78	0,12%	0,00	0,00	0,00	0,00			
ENJG21	1.439.271,84	24.927,48	23.617,12	2,66%	-4.053,82	737,67	708,80	-960,82			
ENM21	938.169,73	16.724,99	15.839,71	1,78%	-182,63	186,26	688,82	-1.048,42			
ENTV12	18.460.986,07	190.955,36	173.861,63	19,55%	0,00	0,00	0,00	0,00			
ERDV17_VENCIMENTO	6.648.913,16	31.109,05	21.062,64	2,37%	0,00	0,00	0,00	0,00			
GASPI7	10.466.163,23	111.628,40	66.879,55	7,52%	-33.795,16	7.757,73	15.748,70	-20.961,07			
GRRB24_VENCIMENTO	16.255.378,99	175.842,40	160.960,67	18,10%	-22.658,90	5.205,62	10.583,79	-14.086,16			
LFSN1600GM	16.120.418,43	42.476,05	18.219,72	2,05%	-1.477.690,83	-208.228,58	554.221,25	-720.435,49			
LFSN1800DC5	5.183.910,78	25.631,69	16.360,31	1,84%	-60.020,62	44.216,45	26.451,75	-35.728,74			
OMGE31	13.168.456,04	276.416,48	257.654,97	28,97%	-191.696,84	286.648,71	217.854,02	-287.489,92			
SBSPC2	3.954.419,47	9.386,34	5.650,20	0,64%	-1.328.987,70	-273.792,49	434.477,63	-570.414,65			
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-48.449,20	26.746,22	12.237,56	-16.592,31			
COMPROMISSADA PRE	6.417.426,36	102,89	44,76	0,01%	-38.640,23	61.669,72	31.693,86	-42.701,95			
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-18.383,64	0,00	0,00	0,00%	-196.523,20	155.397,57	126.525,19	-169.063,22			
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00			
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-21.511,34	3.914,37	3.761,22	-5.098,51			
Total Var:	113.407.169,82	1.052.849,63	889.413,73	100,03%	-3.662.782,16	210.972,23	1.551.780,95	-2.040.670,33			

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		916,41	
PL:	207.542.942,48	VAR / PL:	0,7122%	Status:		Dutation DU:		627,50	
VAR:	1.478.123,06	ETL / PL:	0,6831%	Benchmark:					
ETL:	1.853.625,95	VAR / CDI:	0,0078%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	708.719,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.836.197,02	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.020.340,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	60.370.094,79			
Cenário Alta - 09999 (-):	-11.018.685,12	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.078.497,67	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-847.907,23	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-69.663.383,67			
Cenário Alta - 09999:	-10.309.966,12	Cenário Baixa - 10000:	4.757.699,35	CENARIO BRADESCO 1:	8.172.433,74	CENARIO BRADESCO 2:	-9.293.288,88			

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	476.738,06	45.973,20	11.531,25	0,78%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEPA1	1.879.021,49	742,45	668,44	0,05%	-3.897,62	3.487,58	6.659,99	-9.163,75
APRB28	1.051.001,73	30,07	26,33	0,00%	-156,97	141,84	283,26	-408,12
ARTR1	2.579.294,75	100,44	88,19	0,01%	-533,91	487,12	991,61	-1.437,42
BARU11	1.516.842,33	34.601,12	23.619,06	1,60%	-255.499,97	-6.089,09	132.648,02	-159.843,88
BCBF15	992.482,30	11,56	8,10	0,00%	-70,24	68,87	158,43	-237,34
BRKPA0	2.806.099,91	426,42	379,82	0,03%	-2.203,64	1.975,39	3.937,65	-5.657,42
CAEC11	1.900.041,60	19,91	15,57	0,00%	-117,18	114,26	252,96	-376,20
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	964.484,39	12.689,34	11.609,49	0,79%	-96.057,13	-7.336,55	42.310,35	-53.560,30
CBAN22	5.827.074,50	25.102,99	21.322,00	1,44%	-119.902,27	104.709,00	189.078,58	-247.767,25
CEAB13	1.546.261,62	216,75	193,51	0,01%	-1.117,10	1.005,03	1.977,81	-2.822,84
CELG12	459.562,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CGBP13	2.379.255,27	585,93	527,77	0,04%	-3.078,59	2.754,60	5.274,87	-7.274,05
CLIH2	2.434.163,56	2.133,71	1.890,17	0,13%	-11.434,74	10.156,40	19.218,84	-25.417,87
COMPROMISSADA PRE	14.860.639,86	238,27	67,76	0,00%	-422,92	431,33	1.595,07	-2.427,79
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-68.853,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRTR12	2.842.123,05	53.963,97	42.381,88	2,87%	-396.026,99	-2.220,84	205.771,66	-250.070,47
CSAN23	1.121.666,54	734,49	647,72	0,04%	-3.930,13	3.488,86	6.584,03	-8.674,68
CSMG88	2.763.001,27	34.456,73	28.270,77	1,91%	-212.803,75	-31.436,63	77.294,00	-100.944,43
DAPK25	3.758,39	24.761,48	8.129,58	0,55%	-113.149,58	100.509,76	56.926,14	-57.071,11
DAPK27	-41.627,65	204.979,43	184.160,14	12,46%	-1.006.079,01	1.006.054,30	1.111.012,91	-1.086.465,66
DAPK29	-3.625,54	73.745,75	64.984,26	4,40%	-443.046,28	410.728,59	510.897,00	-487.837,89
DAPK35	-4.104,63	22.107,61	-6.057,61	-0,41%	108.856,39	-95.081,04	-133.770,90	119.339,41
DAPQ26	-37.383,60	138.024,11	109.263,09	7,39%	-701.919,69	734.314,85	712.299,17	-702.770,83
DAPQ28	-66.534,25	340.305,37	326.655,52	22,10%	-1.938.005,63	1.889.872,07	2.226.405,72	-2.143.997,16
DAPQ30	-2.585,92	46.246,15	-31.498,13	-2,13%	277.625,18	-245.037,52	-321.787,25	302.861,32
DAPQ32	-3.015,37	58.457,73	-26.611,45	-1,80%	317.447,31	-286.771,07	-381.798,79	351.025,72
DASACS	1.935.325,73	1.781,35	1.548,31	0,10%	-9.599,60	8.503,57	16.016,50	-20.608,75
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF27	-13.509,35	64.947,87	59.019,24	3,99%	-307.811,95	274.091,52	517.294,90	-721.276,66
DHF28	-3.578,99	21.451,35	19.144,82	1,30%	-104.999,25	94.347,66	173.572,11	-232.300,97
DHF29	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHN26	-5.865,52	25.175,61	22.627,69	1,53%	-117.285,76	104.322,60	203.643,16	-289.977,84
ELET24	2.683.375,99	535,51	482,84	0,03%	-2.778,09	2.493,98	4.802,77	-6.712,87
GUAR15	1.027.639,86	73,49	64,76	0,00%	-383,11	345,30	692,01	-998,79
HAPV22	565.630,26	167,45	150,64	0,01%	-871,91	779,33	1.484,07	-2.043,38
HZTC14	2.324.213,26	31.929,47	29.266,07	1,98%	-229.931,14	-11.940,84	104.514,24	-132.082,98
IDIF25P421800	-9,98	51,82	10,52	0,00%	9,95	-1.550,03	9,98	-59.482.301,18
IDIF25P421900	9,98	59,55	-12,09	0,00%	-9,97	2.741,66	-9,98	59.580.774,33
IRJS14	3.192.896,17	66.153,71	50.556,74	3,42%	-491.526,76	-2.917,15	259.869,14	-312.583,11
JSM185	3.211.806,20	35.661,21	33.161,51	2,24%	-336.369,24	-51.510,95	130.225,90	-167.427,06
LCAMB1	7.366.095,26	83.025,68	76.452,47	5,17%	-790.994,35	-122.796,90	306.442,92	-393.745,40
LF001000FAU	4.676.317,35	42.369,00	29.778,72	2,01%	-385.830,99	-58.452,08	139.129,38	-182.397,79
LF002306ZFP	5.736.231,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.754.385,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	1.007.227,39	0,00	0,00	0,00%	1.329,15	-1.277,00	-2.723,47	4.159,17
LFSC190059S	1.525.647,80	0,00	0,00	0,00%	2.034,55	-1.951,16	-4.160,38	6.353,74
LFSC19005L1	1.009.386,61	0,00	0,00	0,00%	1.416,46	-1.346,76	-2.868,79	4.381,86
LFSC22002X	4.565.414,25	901,59	808,54	0,05%	-4.602,47	4.098,08	8.058,86	-11.523,12
LFNS210029N	4.874.784,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFNS2301ERT	4.736.609,20	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	21.828.377,42	3.738,02	-625,93	-0,04%	-42.004,86	50.669,84	-787,67	1.199,26
LIGHB4	206.970,80	3.047,41	2.469,36	0,17%	-28.033,59	-8.780,76	7.555,20	-7.887,18
LIGHD3	75.266,79	838,65	749,12	0,05%	-6.446,06	-551,43	2.691,02	-3.429,27
LMP17	2.582.420,12	126,84	104,05	0,01%	-667,93	614,42	1.268,38	-1.867,19
LREN1	689.518,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MOVIZ7	1.154.304,24	543,75	489,44	0,03%	-2.852,29	2.551,66	4.870,45	-6.695,95
MTRJ19	2.712.454,72	29.832,47	26.620,12	1,80%	-206.918,09	-26.614,40	79.088,32	-102.477,60
NTEN11	2.865.846,65	34.967,29	27.775,61	1,89%	-188.253,95	-22.353,11	69.028,37	-90.399,52
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	616.345,05	824,14	232,24	0,02%	-4.221,96	3.963,20	1.884,84	-2.548,64
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	21.559.238,95	90.091,85	70.544,58	4,77%	-392.826,52	462.567,78	372.303,05	-494.845,35
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	4.959.325,28	25.311,16	23.269,13	1,57%	-118.949,18	133.483,93	121.585,72	-160.167,27
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	8.132.308,27	49.482,82	47.732,78	3,23%	-268.985,10	300.771,68	288.852,02	-374.982,71
NTNB202500815 - 760199 NEGOCIACAO	444.006,43	11.276,03	1.609,77	0,11%	-56.395,76	48.303,39	61.498,15	-67.090,07
NTSD36	2.878.182,63	2.798,05	2.392,08	0,16%	-15.152,07	13.483,28	25.425,23	-31.741,78
OMGE13	3.134.689,34	780,11	702,94	0,05%	-4.084,99	3.665,03	7.022,66	-9.718,81
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVS10	1.838.613,30	49,36	38,91	0,00%	-263,06	242,50	509,65	-749,80
OVS10A8	698.100,22	329,14	295,54	0,02%	-1.716,70	1.532,62	2.911,23	-3.997,21
RAHD11	3.248.908,91	52.324,86	45.069,23	3,05%	-381.735,10	-1.728,21	193.303,24	-237.493,93
RBCAPMZ	472.535,95	7.129,67	323,17	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.850.728,19	160,33	136,32	0,01%	-851,56	777,37	1.586,72	-2.310,69
RDORB9	1.112.589,16	698,03	615,52	0,04%	-3.736,47	3.316,87	6.259,46	-8.244,86
RDORC9	1.591.002,50	998,18	880,19	0,06%	-5.343,15	4.743,13	8.951,02	-11.790,15
RIS412	2.719.621,23	36.388,55	32.467,47	2,20%	-303.589,71	-37.429,10	126.291,85	-160.447,73
ROCB11	2.749.956,55	2.636,69	2.356,25	0,16%	-14.005,48	12.444,81	23.530,23	-31.567,05
RSAN24	1.847.012,16	21,92	17,53	0,00%	-126,62	122,53	268,17	-398,53
RSNGO18	836.690,28	6,90	4,96	0,00%	-41,88	41,15	83,54	-139,61
TBSP11	2.314.223,00	315,67	283,41	0,02%	-1.650,29	1.485,27	2.909,79	-4.117,99
UNEG11	4.449.269,13	84.688,77	67.701,80	4,58%	-573.953,67	23.545,50	312.189,95	-381.325,21
VAMO33	2.817.291,16	29.777,16	27.435,84	1,86%	-296.883,11	-53.325,05	109.860,45	-141.488,50
VCCS11	191.255,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	-0,01
VECS11	3.582.916,22	8,57	1,24	0,00%	-33,46	36,72	101,69	-153,38

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		916,41	
PL:	207.542.942,48	VAR / PL:	0,7122%	Status:		Dutacion DU:					627,50
VAR:	1.478.123,06	ETL / PL:	0,6931%	Benchmark:							
ETL:	1.853.625,95	VAR / CDI:	0,0078%								

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	708.719,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.836.197,02	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.020.340,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	60.370.094,79
Cenário Alta - 09999 (-):	-11.018.685,12	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.078.497,67	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-847.907,23	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-69.663.383,67
Cenário Alta - 09999:	-10.309.966,12	Cenário Baixa - 10000:	4.757.699,35	CENARIO BRADESCO 1:	8.172.433,74	CENARIO BRADESCO 2:	-9.293.288,88

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL18	2.396.506,71	1.071,66	957,88	0,06%	-5.656,78	5.035,33	9.529,07	-12.885,26
VVRT11	2.417.836,96	162,61	144,44	0,01%	-857,87	776,47	1.547,53	-2.216,09
Total Var:	217.330.128,12	1.965.366,33	1.478.123,06	99,99%	-10.309.966,12	4.757.699,36	8.172.433,75	-9.293.288,88

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV
CNPJ: 41687175000104

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		1.123,89	
PL:	229.152.218,11	VAR / PL:	0,8744%	Status:		Dutacion DU:					769,43
VAR:	2.003.761,25	ETL / PL:	1,0966%	Benchmark:							
ETL:	2.512.797,44	VAR / CDI:	0,0096%								

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	376,57	Cenário Baixa - 10000 (+):	233.667,60	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.744.822,89	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-15.120.200,59	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.241.924,03	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-8.483.330,95
Cenário Alta - 09999:	-15.119.824,03	Cenário Baixa - 10000:	-1.008.256,43	CENARIO BRADESCO 1:	6.744.822,89	CENARIO BRADESCO 2:	-8.483.330,95

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
APPSA2	2.865.589,53	29.758,80	29.077,96	1,45%	-290.741,26	-46.705,89	110.070,38	-141.936,88
ASAB11	2.638.503,47	27.487,41	27.292,41	1,36%	-238.999,39	-38.916,85	90.394,88	-115.963,00
ASER12	4.589.492,32	97.056,11	83.333,63	4,16%	-715.997,81	-424,03	383.043,25	-459.034,00
BRKPF28	5.186.525,60	87.701,82	81.188,32	4,05%	-680.965,46	-81.065,74	293.850,63	-369.778,18
CAEC21	4.519.709,67	72.122,49	53.846,38	2,69%	-299.023,99	-38.108,55	107.289,05	-141.270,83
CAXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.436.184,72	71.521,75	71.224,75	3,55%	-541.412,92	-41.351,47	238.476,51	-301.885,33
CJEN13	4.148.597,44	55.515,65	55.424,59	2,77%	-395.800,87	-19.491,64	180.776,41	-228.180,04
CNRD11	6.994.347,36	107.087,36	105.937,85	5,29%	-741.761,71	-19.539,67	356.021,52	-446.444,96
COMPROMISSADA PRE	85.838.613,82	1.376,29	137,09	0,01%	-2.442,86	2.491,45	9.213,53	-14.023,52
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-106.968,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	3.213.146,79	37.452,38	33.355,47	1,66%	-218.278,66	-16.810,21	88.156,27	-114.445,22
CSMG89	3.249.992,37	40.236,82	39.505,19	1,97%	-339.791,32	-41.257,88	139.628,78	-177.952,20
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENAT24	2.827.654,98	47.084,44	44.287,93	2,21%	-340.521,60	-21.367,59	158.537,43	-198.682,33
ENEVA0	214.202,57	3.718,02	3.457,70	0,17%	-26.981,61	-1.735,45	12.567,17	-15.752,57
ERDV17	4.828.588,49	22.592,09	10.436,58	0,52%	-43.588,31	32.110,97	19.209,85	-25.947,00
ERDV38	6.012.805,00	90.980,84	51.505,78	2,57%	-76.996,35	59.491,23	46.265,60	-61.892,86
GBSP11	3.552.410,89	69.857,33	60.433,53	3,02%	-536.250,53	-9.803,45	281.013,33	-336.192,99
GRRB24	8.577.756,99	92.789,80	82.614,50	4,12%	-701.289,93	-144.476,82	229.268,32	-301.000,57
HGLB23	2.730.630,01	41.299,75	40.826,05	2,04%	-309.912,17	-24.319,10	138.151,71	-174.643,76
HVRD15	5.429.520,01	80.193,19	79.570,54	3,97%	-605.702,93	-43.000,14	272.185,46	-343.342,27
IPIL11	1.325.979,25	15.895,85	15.826,06	0,79%	-111.567,99	-6.710,95	49.198,59	-62.444,18
IRBR12	11.606.118,21	254.705,68	148.461,99	7,41%	-291.157,60	122.940,02	159.838,14	-212.992,10
JALL15	622.938,58	10.966,84	10.191,09	0,51%	-78.743,92	-4.494,36	37.059,65	-46.410,49
LCAM01	10.284.405,08	115.918,90	112.428,87	5,61%	-1.104.371,59	-171.446,74	427.849,90	-549.740,00
LORTA7	6.290.775,78	71.812,03	68.830,31	3,44%	-652.381,37	-67.174,35	273.766,12	-351.457,45
MOVI37	8.512.879,55	94.811,82	92.670,94	4,62%	-896.416,33	-137.690,48	347.100,89	-446.196,66
MTRJ19	2.897.969,76	31.872,82	30.037,28	1,50%	-221.070,00	-28.434,66	84.497,47	-109.486,43
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.301,46	49,77	40,86	0,00%	-250,43	-24,81	93,72	-122,71
QUAT12	3.311.228,83	4.981,36	796,97	0,04%	376,57	763,03	208,46	-282,86
RAHD11	5.651.708,21	91.022,81	87.509,99	4,37%	-664.055,36	-3.006,34	336.264,74	-413.137,59
RDVE11	3.721.861,41	52.112,51	51.789,20	2,58%	-367.402,37	-4.238,90	178.346,04	-222.677,81
RMSA12	7.857.210,75	159.225,31	139.539,76	6,96%	-1.170.612,16	-3.698,28	617.406,43	-745.084,98
TCHI11	4.732.320,20	77.585,11	73.309,01	3,66%	-583.544,06	-7.980,78	295.498,15	-360.556,35
UNEG11	2.999.040,88	57.084,68	51.656,39	2,58%	-386.874,89	15.870,90	210.432,41	-257.033,20
VAM033	1.280.704,97	13.536,32	13.166,62	0,66%	-134.959,31	-24.240,89	49.941,17	-64.318,89
VAM034	7.016.834,96	79.886,80	78.000,67	3,89%	-750.671,15	-116.393,97	290.821,37	-373.663,05
VBR11	2.220.928,39	21.329,73	20.888,95	1,04%	-192.681,60	-31.239,88	70.482,65	-91.625,68
VERO12	3.446.433,04	42.168,77	36.580,11	1,83%	-265.500,14	-42.490,96	94.124,45	-123.085,25
VMT13	1.333.300,27	19.270,38	18.579,91	0,93%	-141.480,67	-4.282,21	67.772,49	-84.746,79
Total Var:	247.925.254,13	2.290.069,84	2.003.761,25	100,00%	-15.119.824,03	-1.008.256,43	6.744.822,89	-8.483.330,95

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/11/2024

FUNDO: **FIR FEM II A CRED PRIV**
CNPJ: **20725957000102**

Dados Gerais		
PL: 231.678,078,49	VAR / PL: 0,1017%	Limite Fundo: 602,34
VAR: 235.677,38	ETL / PL: 0,1276%	Status: ENQUADRADO
ETL: 295.548,95	VAR / CDI: 0,0011%	Benchmark: 0,00% Duration DC: 29/11/2024
		Duration DU: 412,39

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 650.015,95	Cenário Baixa - 10000 (+): 2.242.085,74	CENARIO BRADESCO 1 (+): 2.333.775,77	CENARIO BRADESCO 2 (+): 1.438.165,34
Cenário Alta - 09999 (-): -2.135.523,03	Cenário Baixa - 10000 (-): -580.699,97	CENARIO BRADESCO 1 (-): -1.097.371,85	CENARIO BRADESCO 2 (-): -3.035.522,75
Cenário Alta - 09999: -1.485.507,08	Cenário Baixa - 10000: 1.661.385,77	CENARIO BRADESCO 1: 1.236.403,92	CENARIO BRADESCO 2: -1.597.357,41

Parâmetros do Cálculo			
Modelo: VaR paramétrico	Modelo Volatilidade: EWMA		
Int. Confiança: 95	Lâmbda: 0,94		
Horizonte: 21			

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5ITI	6.977.972,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	5.947.516,93	95,36	22,27	0,01%	-169,26	172,63	638,38	-971,65
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-30.489,33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	632,91	2.710,38	-1.900,80	-0,81%	12.635,52	-11.279,63	-22.469,33	32.673,89
DHF27	18.108,27	87.057,79	-64.986,10	-27,57%	412.598,99	-367.399,27	-693.395,29	966.817,65
DHF29	770,33	11.988,72	-8.511,72	-3,61%	62.400,75	-54.635,97	-101.977,71	131.202,09
DHF33	-743,50	30.740,91	-19.716,19	-8,37%	162.380,68	-147.385,10	-279.517,45	307.453,33
LF002200U5M	11.147.144,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	11.687.178,88	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.589.779,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.964.067,64	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	11.146.771,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	11.126.844,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	11.102.512,33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.576.207,79	57.045,81	42.619,07	18,08%	-282.887,14	251.896,60	475.406,80	-662.871,09
LF0024002SX	4.774.101,33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	11.088.431,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	7.101.701,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003QF	11.683.824,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.729.323,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	7.155.025,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	7.041.330,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400D4A	3.542.026,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	658.091,52	48,36	-6,19	0,00%	-375,53	392,94	-10,82	16,48
LFT20260301 - 210100	282.026,00	31,72	-0,45	0,00%	-982,64	1.402,56	-1,26	1,91
LFT20260901 - 210100	971.404,31	118,15	-2,42	0,00%	-4.729,21	7.114,24	0,43	-0,66
LFT20270301 - 210100	422.688,11	94,20	-18,93	-0,01%	-2.281,50	4.325,84	87,88	-133,77
LFT20270901 - 210100	140.840,03	53,23	-15,94	-0,01%	-904,93	1.804,95	43,62	-66,38
LFT20300301 - 210100	46.702,46	47,71	-16,10	-0,01%	-602,46	1.343,20	76,86	-116,77
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	12.485.389,76	16.694,79	5.708,07	2,42%	-85.524,89	80.283,11	38.181,51	-51.628,18
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	18.499.246,02	77.304,73	64.459,66	27,35%	-537.071,01	396.913,60	319.537,75	-424.609,88
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	14.813.819,34	74.595,30	69.565,38	29,52%	-350.511,74	393.338,88	358.280,95	-471.970,56
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	20.584.771,90	125.252,58	119.982,00	50,91%	-680.864,13	761.323,38	731.151,94	-949.168,83
NTNB20290515 - 760199 NEGOCIACAO	3.190.981,70	21.626,39	19.670,55	8,35%	-134.324,96	123.969,44	133.068,90	-171.469,76
NTNB20500815 - 760199 NEGOCIACAO	2.002.065,36	50.844,66	8.825,23	3,74%	-254.293,63	217.804,38	277.300,76	-302.515,24
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	232.277.065,66	556.340,78	235.677,38	99,99%	-1.485.507,08	1.661.385,77	1.236.403,92	-1.597.357,41

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



Data: 29/11/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais							
PL:	183.036.698,18	VAR / PL:	0,1392%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	368,26
VAR:	254.804,36	ETL / PL:	0,1746%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	251,51
ETL:	319.534,95	VAR / CDI:	0,0015%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	5.362.803,90	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.050.199,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	66.589.489,42	CENARIO BRADESCO 2 (+):	560.002.371,01
Cenário Alta - 09999 (-):	-6.528.759,87	Cenário Baixa - 10000 (-):	-4.810.709,31	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-66.001.752,17	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-561.296.793,96
Cenário Alta - 09999:	-1.165.955,98	Cenário Baixa - 10000:	1.239.490,04	CENARIO BRADESCO 1:	587.737,25	CENARIO BRADESCO 2:	-1.294.422,95

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANBH10	363.091,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BCBF14	87.101,33	0,54	0,41	0,00%	-3,76	3,97	9,72	-14,63
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	3.888.589,43	16.752,01	11.906,77	4,67%	-80.014,54	69.875,60	126.178,06	-165.342,85
CEBEA3	1.860.970,61	93,73	63,10	0,02%	-489,80	444,53	908,75	-1.323,55
CGBP13	1.875.233,29	461,81	332,11	0,13%	-2.426,42	2.171,07	4.157,44	-5.733,12
COMPROMISSADA_PRE	78.935.437,71	1.265,61	249,77	0,10%	-2.246,40	2.291,08	8.472,57	-12.895,74
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-71.922,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMZ24C100500	-20,92	28,21	-8,90	0,00%	0,01	-0,01	-0,02	0,03
CPMZ24C100750	866,59	803,69	-344,35	-0,14%	-0,20	0,26	0,87	-1,33
CPMZ24C101000	239,06	178,41	-48,21	-0,02%	-0,06	0,07	0,24	-0,37
CPT1E2	1.832.051,45	591,94	423,58	0,17%	-3.164,19	2.814,87	5.342,40	-7.146,79
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DH1F25	-1.125,89	13.831,01	8.568,06	3,36%	-25.897,36	30.347,64	107.530,49	-163.180,88
DH1F26	-3.164,66	13.651,91	8.567,33	3,36%	-63.177,62	56.398,15	112.346,63	-163.369,45
DH1F27	-4.896,36	23.491,78	16.266,50	6,38%	-111.336,24	99.139,49	187.106,67	-260.897,30
DH1F31	43,34	14.890,60	-9.610,35	-3,77%	78.831,56	-69.938,77	-131.203,15	155.997,06
DH1J25	-3.201,84	40.329,09	26.105,17	10,25%	-169.812,67	175.331,88	424.887,92	-638.761,95
DH1N26	43.226,35	185.533,31	-122.008,90	-47,88%	864.345,06	-768.812,24	-1.500.761,57	2.137.010,61
DH1Z24	-4,80	961,60	-189,78	-0,07%	1.706,81	-1.740,76	-6.437,43	9.798,13
ELET13	2.010.022,43	59,66	39,66	0,02%	-320,81	298,46	633,58	-936,34
GRRB14	1.082.706,54	11,09	8,13	0,00%	-60,32	55,92	118,67	-174,46
IDIF25P419600	26,12	37,69	19,70	0,01%	-20,23	105,09	-26,12	150.009.128,02
IDIF25P419700	-26,12	38,91	-20,34	-0,01%	20,51	-111,75	26,12	-150.266.855,33
IDIF25P422300	3,95	64,22	33,57	0,01%	-3,95	42.721,57	-3,95	23.737.468,37
IDIF25P422400	-7,90	249,47	-130,41	-0,05%	7,90	-163.214,76	7,90	-47.552.886,43
IDIF25P422500	8.543,85	65.728,01	34.359,72	13,48%	-8.543,85	112.216,08	-8.543,85	23.806.878,16
IDU25P432500	9,37	16,16	12,17	0,00%	-9,37	44.937,18	-9,37	49.918.850,70
IDU25P432600	-18,74	33,55	-25,28	-0,01%	18,74	-108.595,42	18,74	-100.015.293,64
IDU25P432700	9,37	17,44	13,14	0,01%	-9,37	65.969,84	-9,37	50.096.442,94
IDIN25C447900	1.432.558,62	706.200,73	-469.656,85	-184,32%	4.417.611,06	-1.429.647,04	63.903.872,43	-1.429.887,39
IDIN25C448000	-1.338.564,90	688.443,31	457.847,32	179,69%	-4.401.645,79	1.338.241,27	-63.894.876,76	1.335.906,82
IDIN25P442900	7,78	16,11	10,72	0,00%	-7,78	28.518,11	-7,78	34.874.416,86
IDIN25P443000	-7,78	16,35	-10,87	0,00%	7,78	-30.913,92	7,78	-34.944.929,86
IDIN25P443100	-7,78	16,60	-11,04	0,00%	7,78	-33.554,64	7,78	-35.015.442,86
IDIN25P443200	7,78	16,85	11,21	0,00%	-7,78	36.469,26	-7,78	35.085.955,86
IDIN25P445400	15,92	48,81	32,46	0,01%	-15,92	326.224,80	-15,92	37.484.882,19
IDIN25P445500	-23,88	71,73	-47,71	-0,02%	23,88	-367.280,50	23,88	-37.557.018,64
IDIN25P445600	59,70	173,28	115,24	0,05%	-59,70	620.139,99	-59,70	56.443.720,69
IDIN25P445700	-222,82	636,83	-423,53	-0,17%	222,82	-1.836.899,53	222,82	-150.757.739,04
IDIN25P445800	218,90	606,37	403,27	0,16%	-218,90	1.276.155,18	-218,90	94.433.470,46
LCAMC3	2.950.251,45	350,02	241,03	0,09%	-1.808,85	1.621,49	3.232,21	-4.643,88
LF002100HDQ	3.094.399,61	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	1.566.884,58	115,15	-33,53	-0,01%	-894,12	935,58	-25,77	39,23
LFT20250901 - 210100	10.749.653,20	1.840,83	-677,80	-0,27%	-20.685,81	24.952,99	-387,90	590,59
LFT20260301 - 210100	13.286.558,40	1.494,15	-730,88	-0,23%	-46.293,33	66.076,09	-59,12	90,01
LFT20260901 - 210100	9.353.863,47	1.137,62	-66,89	-0,03%	-45.537,68	68.503,26	4,18	-6,36
LFT20270301 - 210100	6.872.595,62	1.531,69	441,78	0,17%	-37.095,47	70.334,94	1.428,93	-2.174,94
LFT20290301 - 210100	4.491.044,69	3.614,79	469,32	0,18%	-34.011,36	102.043,50	5.439,26	-8.268,47
LTN20260701 - 100000	24.953.601,72	166.225,99	109.887,58	43,13%	-784.758,06	694.188,72	1.358.615,79	-1.934.652,64
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	7.277.274,08	9.730,78	-919,44	-0,36%	-49.849,31	46.794,07	22.254,60	-30.092,16
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	2.385.314,55	9.967,76	4.273,27	1,68%	-43.462,33	51.178,51	41.201,57	-54.749,70
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	1.945.555,45	49.409,53	19.048,99	7,48%	-247.115,98	211.656,68	269.473,72	-293.976,50
OMGE13	918.866,60	228,67	164,32	0,06%	-1.197,43	1.074,33	2.058,54	-2.848,86
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.437.755,88	401,85	285,39	0,11%	-2.082,85	1.869,00	3.664,12	-5.213,58
VAMO22	719.190,57	21,59	14,82	0,01%	-119,38	111,54	235,04	-344,94
WDOF25	-13.938,56	170.436,72	159.553,60	62,62%	-344.354,90	379.987,34	-469.097,72	471.724,29
Total Var:	184.995.524,67	2.191.775,58	254.804,36	99,99%	-1.165.955,98	1.239.490,04	587.737,25	-1.294.422,95

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



bradesco

Data: 29/11/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA
CNPJ: 55899189000198

Dados Gerais							
PL:	63.705.456,25	VAR / PL:	0,1814%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	530,58
VAR:	115.577,53	ETL / PL:	0,2275%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	363,13
ETL:	144.938,88	VAR / CDI:	0,002%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	347.995,33	Cenário Baixa - 10000 (+):	601.763,57	CENARIO BRADESCO 1 (+):	207.391,67	CENARIO BRADESCO 2 (+):	541.560,33
Cenário Alta - 09999 (-):	-630.132,62	Cenário Baixa - 10000 (-):	-517.276,47	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-475.888,40	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-236.225,61
Cenário Alta - 09999:	-282.137,30	Cenário Baixa - 10000:	84.487,10	CENARIO BRADESCO 1:	-268.496,73	CENARIO BRADESCO 2:	305.334,72

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CNHG25	-1.140,25	9.228,31	4.551,62	3,94%	36.480,16	-40.868,14	53.240,19	-53.651,85
COMPROMISSADA_PRE	7.229.182,24	115,91	-70,23	-0,06%	-205,73	209,83	775,95	-1.181,04
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-23.147,88	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DAFK35	-1.026,16	5.526,90	142,92	0,12%	27.214,10	-23.770,26	-33.442,73	29.834,85
DAPQ28	1.832,90	9.374,90	6.009,17	5,72%	53.388,59	-52.062,59	-61.333,49	59.063,28
DAPQ32	-618,54	11.991,33	2.273,53	1,97%	65.117,40	-58.824,84	-78.317,70	72.005,28
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	1.537,07	6.582,36	6.040,58	5,23%	30.686,27	-27.393,39	-54.568,36	79.350,87
DHF27	1.580,88	7.600,28	6.598,32	5,71%	36.020,55	-32.074,54	-60.534,51	84.404,72
DHF28	1.193,00	7.150,45	5.701,28	4,93%	34.999,75	-31.449,22	-57.857,37	77.433,66
DHF29	128,39	1.998,12	1.466,12	1,27%	10.400,13	-9.105,99	-16.996,29	21.867,02
DHF30	-14,00	1.093,71	747,93	0,65%	5.767,51	-5.017,54	-9.431,72	11.666,54
DHN26	127,51	547,30	495,30	0,43%	2.549,69	-2.267,88	-4.427,03	6.303,87
DOLF25	1.290,61	15.781,18	9.174,24	7,94%	31.884,71	-35.184,01	43.434,97	-43.678,18
DOLZ24	-13.297,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EUPG25	75,49	7.974,93	-4.397,05	-3,80%	-237.838,18	-184.029,08	-183,95	168,60
ITAGRADE	5.145.019,62	1.581,53	937,59	0,81%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20270301 - 210100	6.011.564,28	1.339,79	186,23	0,16%	-32.447,97	61.523,04	1.249,91	-1.902,45
LFT20270901 - 210100	25.820.672,97	9.758,91	2.103,48	1,82%	-165.904,33	330.907,77	7.996,13	-12.169,10
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	294.965,13	394,41	-18,27	-0,02%	-2.020,51	1.896,67	902,03	-1.219,71
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	34.822,11	145,51	-100,10	-0,09%	-634,49	747,13	601,48	-799,27
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	17.042,35	86,98	-66,05	-0,06%	-408,76	458,70	417,82	-550,40
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	1.596.579,16	9.714,74	-6.810,55	-5,89%	-52.808,62	59.049,14	56.709,01	-73.618,65
NTNB20290515 - 760199 NEGOCIACAO	4.198,66	28,46	-17,42	-0,02%	-176,74	163,12	175,09	-225,62
NTNB20300815 - 760199 NEGOCIACAO	4.228,84	33,43	-14,81	-0,01%	-212,72	193,18	214,75	-273,09
NTNB20320815 - 760199 NEGOCIACAO	179.826,13	1.870,92	-407,89	-0,35%	-11.205,45	10.328,09	11.676,99	-14.552,18
NTNB20350515 - 760199 NEGOCIACAO	128.807,93	1.815,77	-96,47	-0,08%	-10.061,85	8.655,50	10.444,14	-12.698,83
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SWIG25	-329,93	4.069,92	2.134,22	1,85%	12.124,70	-13.583,10	17.695,13	-17.831,95
UNI_PREV	17.249.380,23	39.502,67	33.810,64	29,25%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOF25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOZ24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WINZ24	-5.697,00	29.660,30	22.296,00	19,29%	-116.207,27	127.631,40	-98.795,27	99.461,65
WSPZ24	12.674,52	45.004,35	22.307,17	19,30%	1.361,78	-1.645,90	1.858,08	-1.873,29
Total Var:	63.690.458,66	229.973,28	115.577,53	100,01%	-282.137,30	84.487,10	-268.496,74	305.334,72

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



Data: 29/11/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 3271199000162

Dados Gerais			
PL: 67.040.092,98	VAR / PL: 2,7517%	Limite Fundo: 0,00%	Duration DC: 3,00
VAR: 1.844.712,10	ETL / PL: 3,4507%	Status: ENQUADRADO	Duration DU: 1,00
ETL: 2.313.343,40	VAR / CDI: 0,0303%	Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 30.685.167,13	Cenário Baixa - 10000 (-): -30.941.940,97	CENARIO BRADESCO 1 (+): 8.225.325,59	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-): -0,90	Cenário Baixa - 10000 (-): -30.941.940,05	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -8.292.656,05
Cenário Alta - 09999: 30.685.166,23	Cenário Baixa - 10000: -30.941.940,05	CENARIO BRADESCO 1: 8.225.325,59	CENARIO BRADESCO 2: -8.292.656,05

Parâmetros do Cálculo			
Modelo: VaR paramétrico	Modelo Volatilidade: EWMA		
Int. Confiança: 95	Lambda: 0,94		
Horizonte: 21			

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.424.038,40	265.413,47	156.645,49	8,49%	1.150.471,35	-1.232.535,15	355.364,03	-358.272,88
BMLC11	3.606.839,76	152.435,73	66.112,48	3,58%	3.606.839,76	-3.606.839,76	528.762,71	-533.090,92
BPML11	4.965.568,01	387.537,32	77.396,14	4,20%	4.718.298,21	-4.965.568,01	727.952,27	-733.910,95
BRCR11	25.548,00	1.299,77	1.158,33	0,06%	7.186,80	-6.322,80	3.745,34	-3.775,99
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	16.755,20	1.174,44	749,60	0,04%	9.053,44	-8.152,32	2.456,31	-2.476,42
CEOC11	552.745,29	29.076,14	20.524,05	1,11%	273.526,94	-277.321,22	81.032,46	-81.695,75
CNES11	202.904,04	20.399,16	-865,50	-0,05%	101.452,02	-101.452,02	29.745,73	-29.989,22
COMPROMISSADA_PRE	31.600,23	0,51	-0,32	0,00%	-0,90	0,92	3,39	-5,16
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-516.084,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPUR11	6.011.743,50	506.312,71	380.720,67	20,64%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIGS11	642.988,80	11.626,12	-590,97	-0,03%	325.842,48	-320.045,04	94.262,16	-95.033,75
FMOF11	805,92	217,86	162,34	0,01%	1.611,84	-805,92	118,15	-119,12
FYPQ11	595.469,30	59.920,77	-32.092,02	-1,74%	268.063,08	-247.625,18	74.101,60	-74.708,36
GARE11	2.164.586,80	54.929,96	39.437,38	2,14%	0,00	0,00	317.328,43	-319.925,93
HOFC11	482.095,20	31.167,67	16.256,34	0,88%	0,00	0,00	70.675,16	-71.253,67
HSRE11	4.717.401,48	232.295,73	177.981,20	9,65%	4.730.762,52	-4.717.401,48	691.571,06	-697.231,94
JSRE11	89.996,35	3.132,24	-144,70	-0,01%	24.514,42	-22.744,00	13.193,47	-13.301,46
MALL11	5.311.480,44	214.194,79	134.655,28	7,30%	1.433.296,69	-1.350.262,13	778.663,03	-785.036,81
NEWL11	6.055.535,43	406.235,37	310.506,96	16,83%	3.021.741,45	-3.029.776,47	887.741,49	-895.008,14
NEWU11	1.830.740,20	138.625,98	20.273,09	1,10%	1.830.740,20	-1.830.740,20	268.386,51	-270.583,40
OULG11	1.063.881,00	37.924,59	-24.702,97	-1,34%	531.940,50	-531.940,50	155.964,96	-157.241,61
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.201.049,60	218.858,54	200.585,36	10,87%	2.100.524,80	-2.100.524,80	615.873,87	-620.915,13
QAGR11	5.104.924,00	118.182,96	-10.714,75	-0,58%	2.500.252,55	-2.569.865,15	748.381,86	-754.507,77
RBRP11	1.799.090,11	165.324,90	100.380,92	5,44%	932.474,99	-888.568,41	263.746,61	-265.905,52
RCRB11	5.404.588,00	200.115,01	-63.159,16	-3,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	1.128.339,27	67.805,46	-40.077,47	-2,17%	532.062,42	-574.872,04	165.414,54	-166.768,54
VSHO11	25.116,00	947,40	364,11	0,02%	12.006,50	-12.741,82	3.682,01	-3.712,15
VVMR11	4.084.340,00	235.628,56	188.384,36	10,21%	0,00	0,00	596.764,24	-603.665,45
XPN11	2.848.593,00	78.579,43	17.157,25	0,93%	1.442.001,00	-1.418.395,00	417.603,73	-421.022,05
XPPR11	2.256.413,94	125.417,59	107.608,63	5,83%	1.130.503,19	-1.127.441,57	330.790,28	-333.487,98
Total Var:	67.040.092,95	3.764.780,18	1.844.712,10	99,99%	30.685.166,23	-30.941.940,05	8.225.325,59	-8.292.656,06

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: FIA RVA EMB II CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais			
PL: 92.945.678,91	VAR / PL: 4,0736%	Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
VAR: 3.786.208,43	ETL / PL: 5,1084%	Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
ETL: 4.748.038,12	VAR / CDI: 0,0489%	Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 22.633.055,35	Cenário Baixa - 10000 (+): 22,20	CENARIO BRADESCO 1 (+): 13.346.776,99	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-): -21,77	Cenário Baixa - 10000 (-): -23.816.400,58	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -13.456.069,74
Cenário Alta - 09999: 22.633.033,58	Cenário Baixa - 10000: -23.816.378,38	CENARIO BRADESCO 1: 13.346.776,99	CENARIO BRADESCO 2: -13.456.069,74

Parâmetros do Cálculo			
Modelo: VaR paramétrico	Modelo Volatilidade: EWMA		
Int. Confiança: 95	Lâmbda: 0,94		
Horizonte: 21			

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	2.339.837,65	162.358,47	115.574,55	3,05%	258.429,83	-744.410,25	343.020,20	-345.828,01
B3SA3	2.023.578,54	236.251,35	206.908,39	5,46%	475.846,90	-523.923,28	296.656,61	-299.084,91
BBSA3	2.694.976,00	159.102,11	140.193,46	3,70%	634.304,00	-697.408,00	395.083,48	-398.317,45
BBDC4	2.447.441,40	438.902,50	352.295,61	9,30%	643.349,60	-592.966,80	358.794,91	-361.731,84
BBSSE3	549.892,00	27.625,73	22.435,60	0,59%	108.010,40	-111.290,40	80.614,17	-81.274,04
BPAC11	2.598.024,00	196.341,15	119.621,20	3,16%	848.562,00	-874.731,00	380.870,32	-383.987,95
BRFS3	585.516,00	55.315,68	34.324,75	0,91%	134.579,00	-153.459,00	85.836,65	-86.539,27
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMIG4	778.617,00	49.083,98	20.112,70	0,53%	159.485,63	-253.279,53	114.145,25	-115.079,59
COMPROMISSADA_PRE	764.909,27	12,26	6,87	0,00%	-21,77	22,20	82,10	-124,96
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.129.193,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPL66	1.461.355,00	91.520,49	48.226,05	1,27%	321.498,10	-321.498,10	214.234,64	-215.988,27
CURY3	575.680,00	91.377,92	63.702,06	1,68%	160.699,00	-179.172,00	84.394,69	-85.065,50
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	885.870,00	82.475,57	58.667,26	1,55%	226.378,80	-286.966,80	129.868,54	-130.931,59
ELET3	3.729.901,14	348.594,78	310.823,62	8,21%	1.073.825,19	-1.143.290,12	546.803,51	-551.279,39
ENEV3	607.530,00	114.826,19	71.469,22	1,89%	220.462,38	-311.386,74	89.063,90	-89.792,93
ENGH1	735.843,00	48.507,07	42.703,42	1,13%	133.229,49	-156.461,34	107.874,58	-108.757,60
EQTL3	2.424.312,00	115.615,89	63.540,71	1,68%	523.820,88	-458.884,80	355.404,14	-358.313,31
GGBR4	1.618.316,00	179.756,57	-62.359,61	-1,65%	399.596,50	-407.568,50	237.245,13	-239.187,11
GMAT3	774.082,00	52.952,35	34.189,92	0,90%	138.015,05	-124.784,68	113.480,42	-114.409,32
INTB3	182.400,00	37.339,84	27.562,00	0,73%	87.600,00	-65.400,00	26.739,84	-26.958,72
ITSA4	2.630.979,00	221.257,72	183.751,75	4,85%	509.519,44	-493.328,80	385.701,52	-388.858,70
ITUB4	8.265.306,20	603.719,22	524.853,81	13,86%	1.677.400,79	-1.553.978,98	1.211.693,89	-1.221.612,26
JBSS3	2.339.964,00	218.737,53	28.329,18	0,75%	739.421,10	-857.297,10	343.038,72	-345.846,68
LREN3	883.269,00	230.391,76	183.713,55	4,85%	137.241,00	-202.929,00	129.487,24	-130.547,16
LWSA3	349.316,00	35.174,53	18.903,85	0,50%	156.725,20	-132.441,20	51.209,73	-51.628,91
MRF3	2.081.593,00	377.203,27	-45.704,51	-1,21%	770.533,20	-655.529,90	305.161,53	-307.659,45
MULT3	271.206,00	14.689,79	12.049,17	0,32%	81.213,60	-67.887,00	39.758,80	-40.084,25
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	2.071.332,00	200.830,14	-6.399,40	-0,17%	464.980,50	-650.997,00	303.657,27	-306.142,87
PETR4	9.863.445,10	882.705,08	-91.681,48	-2,42%	2.367.607,16	-3.014.055,83	1.445.981,05	-1.457.817,19
PRIO3	1.160.046,00	84.747,92	8.379,01	0,22%	585.198,99	-395.791,28	170.062,74	-171.454,80
RADL3	1.136.995,84	85.930,43	-14.712,44	-0,39%	255.209,22	-208.859,14	166.683,59	-168.047,99
RAIL3	1.219.515,00	144.361,16	-31.592,32	-0,83%	546.054,30	-403.700,22	178.780,90	-180.244,32
RDR3	1.866.450,00	207.266,01	188.440,75	4,98%	591.330,00	-543.030,00	273.621,57	-275.861,31
RENT3	3.111.624,00	242.898,00	27.783,33	0,73%	1.183.212,00	-722.016,00	456.164,08	-459.898,03
SBFG3	520.713,00	77.727,43	63.578,21	1,68%	203.120,37	-206.001,00	76.336,53	-76.961,38
SBSP3	2.863.784,00	212.567,48	15.065,82	0,40%	753.291,00	-693.539,00	419.830,73	-423.267,28
SRNA3	500.383,00	94.411,18	61.151,24	1,62%	0,00	0,00	73.356,15	-73.956,61
SUZB3	3.588.000,00	251.443,62	-69.965,68	-1,85%	834.468,75	-757.620,00	526.000,80	-530.306,40
TIMS3	674.784,00	66.523,01	43.690,33	1,15%	199.623,60	-164.712,90	98.923,33	-99.733,08
TOTS3	900.688,00	98.264,43	35.036,33	0,93%	182.892,80	-178.300,80	132.040,86	-133.121,69
VALE3	11.502.952,10	1.092.091,84	554.921,53	14,66%	2.569.964,59	-3.059.202,09	1.686.332,78	-1.700.136,32
VBR3	1.019.122,00	73.514,28	64.868,18	1,71%	238.108,00	-264.784,00	149.403,29	-150.626,23
VIVT3	1.733.200,00	169.727,67	126.520,96	3,34%	252.735,00	-265.335,00	254.087,12	-256.166,96
WEGE3	3.473.736,00	355.288,07	235.229,48	6,21%	785.519,00	-918.183,00	509.249,70	-513.418,18
Total Var:	92.945.678,09	8.529.431,49	3.786.208,43	99,98%	22.633.033,58	-23.816.378,38	13.346.776,99	-13.456.069,74

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



Data: 29/11/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		3,00	
PL:	102.367.071,16	VAR / PL:	4,3037%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	4.405.587,43	ETL / PL:	5,3970%	Benchmark:		Dutation DU:			1,00
ETL:	5.524.784,37	VAR / CDI:	0,0474%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	27.034.819,44	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.231.557,73	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.366.128,61	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.528.736,11			
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.116.079,95	Cenário Baixa - 10000 (-):	-24.551.460,36	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.520.224,11	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.483.002,33			
Cenário Alta - 09999:	25.918.739,49	Cenário Baixa - 10000:	-23.319.902,63	CENARIO BRADESCO 1:	12.845.904,51	CENARIO BRADESCO 2:	-12.954.266,22			

Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VAR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	4.387.995,26	298.929,16	275.049,95	6,24%	0,00	0,00	643.280,11	-648.545,70
ALPA4	1.045.170,00	99.817,24	32.502,88	0,74%	246.776,25	-270.002,25	153.221,92	-154.476,13
ASAI3	1.483.020,00	306.871,47	42.797,87	0,97%	464.140,32	-357.317,94	217.410,73	-219.190,36
AZZA3	2.969.945,43	308.767,15	119.438,05	2,71%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBAS3	1.665.683,42	98.336,22	73.046,10	1,66%	392.044,18	-431.046,86	244.189,19	-246.188,01
BBSE3	1.438.437,00	72.264,85	51.297,82	1,16%	282.539,40	-291.119,40	210.874,86	-212.600,99
BPAC11	2.158.085,88	163.093,59	117.431,18	2,67%	704.870,19	-726.607,85	316.375,39	-318.965,09
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.040.388,56	64,78	35,89	0,00%	-114,98	117,27	433,68	-660,08
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-109.510,76	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLES	2.874.012,03	191.911,62	76.005,37	1,73%	584.053,24	-663.096,80	421.330,16	-424.778,98
CPLE6	3.668.117,57	229.723,72	99.909,39	2,27%	806.965,87	-806.965,87	537.746,04	-542.147,78
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLF25	-45.171,25	552.341,21	293.249,73	6,66%	-1.115.964,96	1.231.440,46	-1.520.224,11	1.528.736,11
ELET3	6.587.251,09	615.641,34	516.101,97	11,71%	1.896.446,02	-2.019.125,66	965.691,01	-973.595,71
ENEV3	1.648.358,25	311.547,91	153.703,22	3,49%	598.161,38	-844.858,53	241.649,32	-243.627,35
ENGH11	3.711.383,00	244.655,88	191.657,03	4,35%	671.971,69	-789.146,54	544.088,75	-548.542,41
EQLT3	8.644.233,39	412.245,11	252.203,35	5,72%	1.867.758,75	-1.636.219,81	1.267.244,62	-1.277.617,70
FLRY3	2.106.164,00	228.804,49	173.300,45	3,93%	440.408,80	-408.448,80	308.763,64	-311.291,04
GGPS3	1.330.020,00	101.660,83	48.351,18	1,10%	591.366,30	-601.218,30	194.980,93	-196.576,96
HAPV3	3.816.541,80	803.122,54	576.496,55	13,09%	1.316.565,57	-1.288.436,24	559.505,03	-564.084,88
IGTH11	7.499.274,05	509.437,65	453.352,33	10,29%	1.579.742,64	-1.446.596,26	1.099.393,58	-1.108.392,71
ITSA4	3.746.925,00	315.105,55	245.091,92	5,56%	725.635,26	-702.577,26	549.299,21	-553.795,52
NTCO3	2.964.337,72	256.244,73	-31.608,12	-0,72%	669.004,89	-784.332,15	434.571,91	-438.129,12
ONCO3	35.534,00	14.557,34	9.405,92	0,21%	11.776,75	-12.754,75	5.209,28	-5.251,93
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	517.370,00	46.300,77	-9.713,74	-0,22%	124.188,75	-158.097,10	75.846,44	-76.467,29
PRIO3	4.203.019,26	307.054,31	-10.747,15	-0,24%	2.120.263,01	-1.434.010,70	616.162,62	-621.206,25
RAIL3	7.445.343,30	881.349,08	-45.765,07	-1,04%	3.333.752,95	-2.464.657,45	1.091.487,33	-1.100.421,74
RECV3	423.754,80	54.507,68	-17.231,18	-0,39%	240.315,60	-257.737,20	62.122,45	-62.630,96
RENT3	5.599.870,96	437.134,25	162.830,79	3,70%	2.129.381,48	-1.299.384,64	820.941,08	-827.660,93
SCAR3	121.481,00	6.198,21	2.613,33	0,06%	70.528,60	-73.478,60	17.809,12	-17.954,89
SMFT3	4.766.352,00	622.075,52	451.052,90	10,24%	1.961.476,80	-1.882.996,80	698.747,20	-704.466,83
SUZB3	7.906.516,80	554.081,17	-43.122,88	-0,98%	1.838.835,34	-1.669.491,43	1.159.095,36	-1.168.583,18
VBBR3	2.405.458,00	173.517,52	140.180,94	3,18%	562.012,00	-624.976,00	352.640,14	-355.526,69
WDOF25	10.841,10	132.561,89	-70.379,93	-1,60%	267.831,59	-295.545,71	364.853,79	-366.896,67
WDOZ24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
YDUQ3	1.303.981,75	174.903,42	77.049,37	1,75%	535.985,84	-311.193,48	191.163,73	-192.728,50
Total Var:	102.371.184,41	9.524.828,22	4.405.587,43	100,00%	25.918.739,49	-23.319.902,63	12.845.904,51	-12.954.266,22

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO: FIA RVA EMB IV CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais							
PL:	94.006.577,72	VAR / PL:	4,1549%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,00
VAR:	3.905.920,82	ETL / PL:	5,2105%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	4.896.182,29	VAR / CDI:	0,0458%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	25.373.782,32	Cenário Baixa - 10000 (+):	209,63	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.921.229,15	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-205,54	Cenário Baixa - 10000 (-):	-22.793.877,51	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-13.027.394,74
Cenário Alta - 09999:	25.373.576,77	Cenário Baixa - 10000:	-22.793.667,88	CENARIO BRADESCO 1:	12.921.229,15	CENARIO BRADESCO 2:	-13.027.394,74

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	1.418.982,18	87.570,58	4.995,45	0,13%	414.469,44	-445.842,47	208.022,79	-209.725,57
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	7.222.451,96	115,80	65,16	0,00%	-205,54	209,63	775,23	-1.179,94
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-1.352.518,54	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	1.969.837,20	131.535,51	73.401,96	1,88%	400.307,92	-454.484,09	288.778,13	-291.141,94
CPLE6	2.332.905,18	146.103,18	84.435,07	2,16%	513.239,14	-513.239,14	342.003,90	-344.803,39
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	10.880.785,79	717.265,83	645.599,03	16,53%	1.970.041,90	-2.313.567,33	1.595.123,20	-1.608.180,14
ENG4	14,32	0,96	0,82	0,00%	11,49	-11,45	2,10	-2,12
EQTL3	13.865.625,97	661.254,30	395.334,28	10,12%	2.995.944,58	-2.624.548,74	2.032.700,77	-2.049.339,52
GGPS3	4.978.940,40	380.568,12	223.396,14	5,72%	2.213.784,43	-2.250.665,47	729.912,66	-735.887,39
GMAT1	1.571,60	4.158,27	-1.906,31	-0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
GMAT3	4.944.199,24	338.216,07	227.272,15	5,82%	881.526,64	-797.021,92	724.819,61	-730.752,65
HAPO3	4.603.386,60	968.639,67	742.370,65	19,01%	1.587.997,88	-1.554.069,22	674.856,48	-680.380,54
ITUB4	6.066.566,60	443.117,63	372.559,44	9,54%	1.231.178,06	-1.140.588,96	889.388,66	-896.638,54
MATD3	626.083,22	39.634,00	12.010,73	0,31%	174.029,91	-195.253,07	91.783,80	-92.535,10
MULT3	4.783.407,72	259.091,81	220.965,97	5,66%	1.432.408,43	-1.197.359,94	701.247,57	-706.987,66
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	10.941.040,08	799.304,80	84.338,15	2,16%	5.519.337,69	-3.732.928,05	1.603.956,48	-1.617.085,72
RAIL3	6.654.389,60	787.719,23	-126.740,27	-3,24%	2.979.592,75	-2.202.825,34	975.533,52	-983.518,78
RENT3	1.011.841,50	78.985,85	10.748,71	0,28%	384.758,25	-234.786,00	148.335,96	-149.550,17
S BSP3	1.948.581,86	144.635,60	20.551,58	0,53%	512.555,83	-471.899,25	285.662,10	-288.000,40
UGPA3	10.091.016,78	1.169.659,72	851.779,04	21,81%	1.925.111,76	-2.400.694,52	1.479.343,06	-1.491.452,28
VBBR3	1.016.460,73	73.322,31	64.783,07	1,66%	237.486,22	-264.092,56	149.013,14	-150.232,90
Total Var:	94.006.569,99	7.230.959,49	3.905.920,82	100,03%	25.373.576,77	-22.793.667,88	12.921.229,15	-13.027.394,74

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI 41901871000163									
Dados Gerais									
PL:	115.557.922,07	VAR / PL:	4,1900%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	5,18		
VAR:	4.841.860,15	ETL / PL:	5,2544%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2,50		
ETL:	6.071.887,96	VAR / CDI:	0,0462%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	27.857.296,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.176,25	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.636.303,96	CENARIO BRADESCO 2 (+):	50,79		
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.808,65	Cenário Baixa - 10000 (-):	-30.071.164,07	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-33,36	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.772.079,80		
Cenário Alta - 09999:	27.855.487,66	Cenário Baixa - 10000:	-30.068.987,82	CENARIO BRADESCO 1:	16.636.270,60	CENARIO BRADESCO 2:	-16.772.029,00		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
VALE3	13.688.216,16	1.299.561,11	723.292,58	14,94%	3.058.191,54	-3.640.371,54	2.006.692,49	-2.023.118,35	
VAM03	152.630,19	26.315,78	-7.538,62	-0,16%	52.708,82	-61.368,41	22.375,59	-22.558,74	
VBBR3	1.151.277,78	83.047,33	70.743,80	1,46%	268.984,92	-299.120,16	168.777,32	-170.158,86	
VIV3	156.841,20	21.723,00	18.637,11	0,38%	40.561,20	-50.547,60	22.992,92	-23.181,13	
VIVT3	1.099.938,24	107.714,03	83.957,53	1,73%	160.392,85	-168.389,17	161.250,95	-162.570,87	
WEGE3	3.732.270,42	381.730,55	257.390,66	5,32%	843.981,62	-986.519,20	547.150,84	-551.629,57	
WINZ24	18.357,00	95.572,09	95.406,92	1,97%	374.445,66	-411.256,74	318.340,30	-320.487,53	
YDUQ3	145.715,25	19.544,83	2.259,74	0,05%	59.894,48	-34.774,75	21.361,86	-21.536,71	
Total Var:	115.557.452,59	10.974.533,39	4.841.860,15	99,99%	27.855.487,66	-30.068.987,82	16.636.270,61	-16.772.029,00	

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/11/2024

FIA EMB VIII ETF 45622039000189									
Dados Gerais									
PL:	86.363.164,86	VAR / PL:	4,3546%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,00		
VAR:	3.760.797,53	ETL / PL:	5,4609%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00		
ETL:	4.716.191,82	VAR / CDI:	0,048%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	7.348.820,20	Cenário Baixa - 10000 (+):	4,19	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.308.036,09	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-4,10	Cenário Baixa - 10000 (-):	-8.020.620,20	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-6.359.678,72		
Cenário Alta - 09999:	7.348.816,10	Cenário Baixa - 10000:	-8.020.616,01	CENARIO BRADESCO 1:	6.308.036,09	CENARIO BRADESCO 2:	-6.359.678,72		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
BOVA11	43.178.959,89	1.875.745,00	1.875.074,72	49,86%	0,00	0,00	0,00	0,00	
BOVV11	43.028.790,00	1.886.387,90	1.885.721,43	50,14%	7.348.820,20	-8.020.620,20	6.308.020,61	-6.359.655,16	
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
COMPROMISSADA_PRE	144.220,48	2,31	1,38	0,00%	-4,10	4,19	15,48	-23,56	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	2.194,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
Total Var:	86.363.164,86	3.762.135,21	3.760.797,53	100,00%	7.348.816,10	-8.020.616,01	6.308.036,09	-6.359.678,72	

3. RISCO DE CRÉDITO

Para o acompanhamento do risco de crédito da carteira, a Entidade adotará as notas emitidas por agências de *rating* (agências de avaliação de risco de crédito) para os títulos privados de crédito. Limites de alocação por classificação de risco e a lista das agências de *rating* estão definidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV. O seguinte relatório elaborado pelo administrador é utilizado pela EMBRAER PREV para o controle de risco de crédito:

3.1. Relatório de Risco de Crédito

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/11/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS				INFORMAÇÕES DE RATING			
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.602.794,54	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	759.779,43	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.693.955,52	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.135.000,04	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.186.828,47	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.871.979,73	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.152.401,57	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	683.397,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	683.397,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	683.397,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	682.307,49	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	683.397,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.531.528,82	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	7.529.029,89	brA	Aa1.br	AA(bra)
FIR F EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	5.621.291,05	-	Aa3.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	737.957,18	brA+	A1.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	587.423,55	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.719.407,76	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.118.113,76	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.403.763,94	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	751.250,13	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.078.296,58	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	9.015.001,67	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	928.818,35	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	642.494,51	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	85.987,22	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.709.231,40	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.720.165,75	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.525.198,18	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	661.353,72	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.574.185,99	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.873.864,97	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.591.501,19	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.842.547,64	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.664.548,40	brAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.647.094,61	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	16.020.251,77	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	748.430,35	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.509.713,62	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.429.477,43	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	931.765,47	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	5.146.208,78	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.806.159,17	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.397.205,04	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	02/12/24	QUATA	590.196,33	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	164.443,29	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	164.443,29	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	165.948,60	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	337.293,90	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	332.234,50	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	492.991,50	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/06/25	BNBM	602.535,45	brAAA	AABr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/06/25	BNBM	912.656,30	brAAA	AABr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	380.851,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	519.873,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.502.186,48	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.772.223,24	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.992.479,91	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	568.289,72	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	120.185,25	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	266.902,05	brAAA	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	4.698,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.841.560,89	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.204.119,63	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.070.572,39	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	556.697,64	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.408.239,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	821.596,82	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.048.280,91	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	897.530,70	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	705.322,27	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.181.594,16	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	361.551,28	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	656.354,55	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.066.525,61	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.042.675,04	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.587.926,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.217.452,88	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.059.516,84	-	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/11/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	699.712,21	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	62.660,80	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	313.303,98	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.000.354,79	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	365.814,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.038.998,85	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.086.302,05	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	848.793,70	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	848.793,70	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.090.706,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	423.697,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	423.697,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.549.111,29	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.301.953,08	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	854.767,28	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	644.610,63	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	3.084.498,51	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	898.277,69	brAA+	-	-
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.807.184,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.271.178,27	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	367.500,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.082.002,83	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.416.335,27	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	06/06/25	BNBMB	599.251,63	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	288.414,54	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	02/12/24	QUATA	2.643.668,09	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.125.912,26	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	711.622,59	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	664.958,81	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/12/24	VERT-10	40.066,95	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	980.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.511.611,54	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	1.009.107,89	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	4.067,99	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.405.753,84	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.119.036,53	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	554.411,84	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	600.575,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	859.333,48	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	539.004,22	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.839.999,04	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	908.737,93	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	74.139,46	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	746.610,60	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	844.264,78	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.013.296,74	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.509.452,05	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.712.416,88	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.748.272,54	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	02/12/24	QUATA	1.285,83	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.586.867,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.643.995,86	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.785.801,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	02/12/24	QUATA	55.290,72	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.462.107,89	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	02/12/24	QUATA	38.574,92	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.659.405,65	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.623.091,48	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	4.563.054,26	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.685.435,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.771.386,86	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.450.397,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	298.623,64	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.105.805,27	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.233.927,59	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.629.453,07	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	1.186.379,82	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	10/12/24	CELG	460.202,03	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	153.615,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.166.704,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	2.963.742,24	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.147.761,84	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.683,54	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.249.921,46	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	1.780.465,06	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.392.907,35	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.044.307,22	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	828.282,03	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	295.293,27	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.818.607,54	-	Aa3.br	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/11/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	664.958,81	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	2.194.807,87	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.436.684,94	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.193.197,48	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.088.722,20	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.385.354,81	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.791.078,16	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.847.886,08	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALZA	2.874.241,52	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	58.106,46	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	301.285,99	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.360.732,93	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.047.484,63	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	388.566,77	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.178.268,49	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	288.021,19	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.625.480,52	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	772.529,13	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	772.529,13	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.330.448,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.283.038,16	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	201.930,38	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.017.719,74	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.097.260,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.168.540,55	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.356.725,59	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.427.273,62	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	11.569.665,18	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.961.148,54	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.946.639,16	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	02/12/24	QUATA	2.571,66	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.736.584,28	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.628.347,70	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.591.122,43	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.543.206,21	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUZ A	1.514.175,01	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.722.543,27	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.290.198,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.646.838,01	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.009.216,18	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.549.435,20	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	934.384,78	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.372.317,28	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.067.439,48	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.004.663,18	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.158.504,25	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	11.078.309,25	brAAA	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	11.070.242,53	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	11.108.813,65	brAAA	AA+br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.926.893,02	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.137.414,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.929.542,20	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	52.726,23	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.879.851,46	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.730.862,72	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.463.102,52	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	11.050.567,20	brAAA	AA+br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.731.798,95	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	7.076.807,71	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.090.175,76	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.212.174,58	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.527.378,06	-	AA+br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.292.916,03	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.646.880,54	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	2.126.384,72	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	1.896.240,20	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	546.875,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.304.881,28	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/12/24	VERT-10	155.396,64	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	1.880.539,54	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.542.752,62	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.719.482,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	277.619,73	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	292.636,99	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	728.342,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	796.529,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	277.619,73	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	313.617,37	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	92.971,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	518.289,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	495.854,33	brAA	-	AA-(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/11/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.618.852,02	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	7.102.875,12	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.006.861,11	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.206.516,53	brAAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	7.001.202,66	-	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.514.826,98	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.566.361,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	648.492,74	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/07/24	17/07/24	15/07/34	CSMG	2.941.305,98	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	05/08/24	01/08/24	15/07/27	CEA MODA	1.490.230,74	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/24	01/08/24	11/06/30	VIX LOGI	2.285.625,62	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	05/06/24	15/05/34	JALLES M	564.938,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.260.542,07	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	09/05/24	15/04/34	ENEVA	196.064,94	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/08/24	30/08/24	15/08/41	ROD TRIA	2.462.210,83	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	587.004,99	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	501.572,48	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/11/24	06/11/24	15/10/34	HIGHLINE	2.289.776,07	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/24	12/08/22	15/12/30	SSIOO	1.986.115,11	-	A-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	1.521.155,84	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	1.705.562,72	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	24/06/24	15/06/34	QGEP	2.449.658,98	brAA-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	700.000,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.291.666,67	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	440.612,93	brAA-(sf)	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	476.738,06	-	AAA.br	-

Observação: Em novembro de 2024, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de sua classificação de risco e ficou abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimento do Plano Embraer Prev.

4. RISCO OPERACIONAL

Para acompanhamento do risco operacional, são monitorados o fluxo de informações, processos e movimentações nas carteiras e/ou fundos exclusivos da Entidade, sempre que ocorram, para atestar que os controles implementados estejam sendo eficientes.

5. RISCO DE LIQUIDEZ

Para acompanhamento do risco de liquidez, a EMBRAER PREV realiza, anualmente, estudo de *LDI (Liability Driven Investments)*, elaborado pelo atuário do Plano Embraer Prev, em conjunto com o consultor de investimentos da Entidade, que avalia o comprometimento do Patrimônio de Cobertura, no que diz respeito à sua liquidez, quando confrontado com o respectivo fluxo de receitas e despesas previdenciais, conforme exigido pela Resolução CGPC Nº 04/2002. Semestralmente, com base no resultado da campanha de alteração de perfis de investimento, o atuário do Plano realiza ainda, estudo de fluxo de liquidez para atestar que a estratégia da carteira de investimento vigente esteja aderente ao estudo de *LDI* anual.

6. RISCO LEGAL

Para acompanhamento do risco legal, a Entidade controlará diariamente seus investimentos, através dos relatórios elaborados pelo administrador dos fundos e/ou carteiras da EMBRAER PREV, para que estes estejam enquadrados às determinações legais e aos limites estabelecidos na Política de Investimento dos Planos sob sua administração. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle do risco legal:

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **5.131.975.160,56**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.552.060.554,30	5.131.975.160,56	88,70%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.899.248.438,64	5.131.975.160,56	75,98%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	652.812.115,67	4.105.580.189,63	12,72%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	1.026.395.047,41	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	513.197.523,70	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.282.993.790,14	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.282.993.790,14	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	476.445.641,21	3.592.382.551,21	9,28%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.282.993.790,14	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	74.543.355,30	1.026.395.047,41	1,45%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	29.136.258,48	769.796.304,67	0,57%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	1.026.395.047,41	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	513.197.523,70	0,00%	Enquadrado

(*) O Relatório Completo de Enquadramentos Legais está disponível no portal da EMBRAER PREV (www.embraerprev.com.br)

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
05/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,7195%	6,6964%	6,5495%	6,8102%	0,0231%	NÃO
06/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,7095%	6,6827%	6,5464%	6,8071%	0,0268%	NÃO
06/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,7095%	6,6827%	6,5464%	6,8071%	0,0268%	NÃO
07/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6795%	6,6119%	6,5327%	6,7935%	0,0676%	NÃO
07/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6795%	6,6119%	6,5327%	6,7935%	0,0676%	NÃO
08/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,6205%	6,5798%	6,4622%	6,7230%	0,0407%	NÃO
08/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,6405%	6,5798%	6,4622%	6,7230%	0,0607%	NÃO
08/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,6605%	6,5798%	6,4622%	6,7230%	0,0807%	NÃO
11/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,6505%	6,6050%	6,4302%	6,6910%	0,0455%	NÃO
11/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,6305%	6,6050%	6,4302%	6,6910%	0,0255%	NÃO
11/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,6455%	6,6050%	6,4302%	6,6910%	0,0405%	NÃO
12/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,5995%	6,7576%	6,4553%	6,8929%	-0,1581%	NÃO
19/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7105%	6,6612%	6,5110%	6,7972%	0,0493%	NÃO
21/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7205%	6,6211%	6,5322%	6,8185%	0,0994%	NÃO
25/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,5491%	4,4963%	4,0683%	4,9703%	0,0528%	NÃO
25/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,9790%	7,0200%	6,7698%	7,2073%	-0,0410%	NÃO
26/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,4892%	4,4253%	3,9967%	4,9065%	0,0639%	NÃO
26/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	7,0190%	7,0304%	6,7978%	7,2354%	-0,0114%	NÃO
28/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7700%	6,8416%	6,6410%	6,9277%	-0,0716%	NÃO
29/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,8305%	6,8212%	6,7123%	7,2022%	0,0093%	NÃO
29/11/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,8305%	6,8212%	6,7123%	7,2022%	0,0093%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



FIRF EMB II A CRED PRIV												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
19/11/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6995%	6,6612%	6,5110%	6,7972%	0,0383%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
28/11/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7810%	6,8416%	6,6410%	6,9277%	-0,0606%	NÃO
28/11/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7810%	6,8416%	6,6410%	6,9277%	-0,0606%	NÃO
29/11/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,8010%	6,8212%	6,7123%	7,2022%	-0,0202%	NÃO
29/11/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,8010%	6,8212%	6,7123%	7,2022%	-0,0202%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
05/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,8396%	4,9379%	4,4909%	5,5827%	-0,0983%	NÃO
05/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP_INV	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,9533%	6,9500%	6,7175%	7,1528%	0,0033%	NÃO
05/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	6,8970%	6,8842%	6,6688%	7,0576%	0,0128%	NÃO
05/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,9345%	6,9300%	6,7625%	7,1090%	0,0045%	NÃO
06/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2035	Compra	6,6995%	6,6952%	6,5312%	6,8115%	0,0043%	NÃO
08/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/09/2027	Venda	0,0621%	0,0615%	0,0538%	0,0729%	0,0066%	NÃO
13/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP CCTVM	LFT	01/03/2027	Compra	0,0476%	0,0472%	0,0180%	0,0555%	0,0004%	NÃO
21/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,4260%	4,4952%	4,0959%	4,9824%	-0,0692%	NÃO
21/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,9174%	6,9599%	6,8596%	7,2073%	-0,0425%	NÃO
21/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2029	Compra	6,8194%	6,8600%	6,7660%	7,1048%	-0,0406%	NÃO
21/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/08/2030	Compra	6,8262%	6,8300%	6,7402%	7,0709%	-0,0038%	NÃO
21/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Compra	6,6895%	6,7002%	6,6027%	6,9047%	-0,0107%	NÃO
27/11/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2032	Compra	6,8595%	7,0078%	6,7004%	7,1610%	-0,1483%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
01-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	DIRR3	30,91	3.700,00	114.374,94	30,49	31,12	31,84	13.507,00
01-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	IGTI11	20,54	15.700,00	322.413,34	20,40	20,66	21,20	10.857,00
01-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	RAIL3	19,42	13.900,00	269.929,24	19,33	19,51	19,96	31.589,00
01-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	22,11	6.100,00	134.870,91	21,98	22,14	22,54	19.785,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,68	1.000,00	21.678,12	21,55	21,72	22,27	17.375,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,43	8.400,00	62.403,68	7,33	7,40	7,55	24.786,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,81	1.000,00	40.807,47	39,95	40,51	41,30	7.013,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,40	1.500,00	60.593,65	39,95	40,51	41,30	7.013,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBD4	14,19	8.200,00	116.358,00	14,05	14,16	14,47	65.807,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBD4	14,19	63.400,00	899.669,11	14,05	14,16	14,47	65.807,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,37	600,00	20.622,02	34,11	34,32	34,59	11.118,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,75	500,00	15.874,31	31,63	31,81	32,58	20.332,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL3	8,45	1.600,00	13.519,13	8,42	8,51	8,71	7.032,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,60	3.000,00	28.808,86	9,50	9,58	9,81	22.268,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,78	3.600,00	132.410,39	36,47	36,85	38,00	26.014,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENG11	42,32	400,00	16.928,36	41,90	42,25	43,03	13.536,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	31,69	3.200,00	101.422,98	31,41	31,63	32,22	24.422,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,40	60.600,00	205.964,39	3,32	3,39	3,54	41.728,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,70	4.000,00	82.790,47	20,40	20,66	21,20	10.857,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,52	10.900,00	114.623,61	10,48	10,55	10,64	27.247,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,12	7.000,00	63.863,20	8,78	9,04	9,59	22.422,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,63	1.100,00	14.991,22	13,53	13,64	13,81	14.183,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	40,03	2.400,00	96.070,44	39,65	40,12	41,46	28.565,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,34	3.400,00	140.542,44	40,66	41,16	42,53	22.479,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,11	700,00	14.777,60	21,01	21,21	22,04	5.579,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,90	1.800,00	107.817,78	59,45	59,90	60,19	24.916,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,87	600,00	35.920,03	59,45	59,90	60,19	24.916,00
01-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,17	2.600,00	26.429,35	10,11	10,28	10,73	9.324,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	AIEC11	45,06	7.628,00	343.704,43	44,90	45,09	45,60	1.127,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	81,56	136,00	11.092,47	81,31	81,90	83,98	392,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,35	108.997,00	1.019.109,63	9,25	9,34	9,35	332,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	25,10	2.748,00	68.974,80	25,10	25,17	26,00	538,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	96,00	10,00	960,00	95,99	95,99	96,00	4,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	66,70	367,00	24.479,78	66,48	67,11	67,50	56,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	103,42	100,00	10.342,00	102,50	102,83	103,42	157,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	31,38	2.003,00	62.858,60	31,10	31,43	32,00	40,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	33,39	992,00	33.119,98	33,33	33,39	33,90	99,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPIN11	72,00	4.011,00	288.778,33	71,80	72,04	73,20	700,00
01-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	14,74	4.144,00	61.074,33	14,61	14,73	14,97	752,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,24	2.100,00	46.696,86	21,74	22,24	22,46	11.609,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	7,69	1.500,00	11.530,84	7,40	7,65	7,79	25.651,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,21	1.000,00	26.210,39	26,15	26,42	26,77	20,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBD4	14,13	25.500,00	360.418,11	13,94	14,10	14,30	37.713,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,23	400,00	13.690,45	34,03	34,30	34,66	11.875,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,79	1.000,00	32.794,73	31,95	32,72	33,15	22.792,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL3	8,63	3.600,00	31.075,65	8,49	8,63	8,66	10.061,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,73	4.100,00	39.891,68	9,63	9,72	9,77	14.551,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,51	500,00	18.755,41	37,02	37,60	37,82	17.389,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,83	1.700,00	21.807,46	12,70	12,86	13,01	13.859,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENG11	42,96	800,00	34.369,61	42,21	42,94	43,41	9.980,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQL3	32,26	3.100,00	100.019,63	31,69	32,21	32,43	18.514,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,83	1.300,00	21.879,00	16,72	16,98	17,21	5.842,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,00	500,00	8.501,58	16,72	16,98	17,21	5.842,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,46	10.800,00	37.399,74	3,37	3,45	3,52	45.201,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,03	1.000,00	21.029,49	20,51	21,07	21,39	8.299,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,60	3.200,00	33.928,07	10,56	10,64	10,74	19.372,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,67	8.174,00	79.030,34	9,14	9,61	9,88	34.561,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,39	2.700,00	38.862,47	13,73	14,25	14,61	28.880,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,62	25.100,00	894.018,90	35,38	35,61	35,95	41.102,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	40,99	800,00	32.789,13	40,33	40,93	41,34	26.204,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,28	3.900,00	79.108,10	19,54	20,24	20,46	31.996,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,16	700,00	12.010,41	16,62	17,10	17,30	6.094,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,82	2.300,00	50.179,62	21,19	21,78	22,23	11.603,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,85	1.700,00	101.737,62	59,51	59,81	60,15	19.241,00
04-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,83	1.700,00	18.418,73	10,32	10,71	11,07	11.575,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	26,18	9.200,00	240.868,72	26,06	26,19	26,29	26.852,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBD4	13,97	17.583,00	245.548,68	13,86	13,96	14,12	39.764,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,43	100,00	3.443,34	34,22	34,88	35,32	14.484,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,01	200,00	3.402,95	16,76	16,92	17,10	6.121,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,80	2.200,00	36.960,00	16,76	16,92	17,10	6.121,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,38	27.500,00	92.855,44	3,33	3,38	3,45	30.696,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,34	1.600,00	56.538,74	35,03	35,35	35,60	38.225,00
05-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	40,30	1.400,00	56.423,73	39,96	40,33	41,07	20.330,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,94	1.700,00	37.294,04	21,66	21,99	22,24	16.142,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,33	1.400,00	56.465,75	39,75	40,51	41,43	7.923,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,52	2.000,00	65.037,80	32,16	32,81	33,44	19.380,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	8,44	4.400,00	37.155,96	8,35	8,46	8,52	10.090,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,52	2.600,00	24.750,64	9,42	9,53	9,60	15.584,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,51	1.300,00	12.367,54	9,42	9,53	9,60	15.584,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,73	1.500,00	55.094,71	36,27	36,70	37,04	26.599,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,39	300,00	4.317,68	14,25	14,37	14,48	10.362,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,84	1.300,00	21.893,79	16,46	16,98	17,33	7.213,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,35	13.700,00	45.953,41	3,29	3,35	3,40	26.820,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,56	5.400,00	111.010,48	20,33	20,59	20,88	14.222,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,32	1.200,00	42.388,80	35,04	35,28	35,46	61.138,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	40,08	700,00	28.055,18	38,85	40,28	41,05	33.132,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,92	3.100,00	185.761,39	59,20	59,91	61,41	27.861,00
06-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,70	1.500,00	16.049,05	10,34	10,68	10,94	8.770,00
06-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,91	1.674,00	41.699,98	24,69	25,03	25,42	23.087,00
06-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,89	2.172,00	54.065,67	24,69	25,03	25,42	23.087,00
06-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	40,03	2.485,00	99.462,97	38,85	40,28	41,05	33.132,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,94	1.300,00	28.523,63	21,81	22,20	22,60	10.688,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,20	10.200,00	73.462,36	7,00	7,32	7,77	36.446,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,48	400,00	16.190,71	39,80	40,74	41,80	5.087,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,80	900,00	15.120,93	16,67	16,88	17,43	7.105,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,75	1.300,00	21.775,00	16,67	16,88	17,43	7.105,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,31	28.000,00	92.766,27	3,28	3,35	3,46	19.420,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,38	1.500,00	30.574,16	20,16	20,62	21,28	11.563,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,11	3.500,00	73.895,94	20,80	21,23	22,28	15.710,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,88	2.200,00	129.531,46	58,39	58,94	59,47	29.978,00
07-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,42	3.500,00	36.486,77	10,24	10,57	11,20	13.021,00
07-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	MAXR11	67,30	32.594,00	2.193.576,20	66,65	67,30	67,98	74,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,74	2.900,00	63.040,23	21,55	21,70	21,82	17.121,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,56	23.300,00	152.786,58	6,42	6,71	7,18	16.565,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,82	55.600,00	379.182,16	6,42	6,71	7,18	16.565,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,02	14.200,00	99.735,87	6,90	7,02	7,36	35.184,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	25,99	1.100,00	28.586,98	25,90	25,99	26,13	43.743,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,32	700,00	24.025,59	34,22	34,42	34,68	15.358,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,38	1.400,00	45.326,77	32,02	32,31	32,72	18.891,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,37	5.200,00	43.507,54	8,26	8,35	8,42	7.049,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,38	4.100,00	38.457,88	9,32	9,38	9,45	17.651,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,30	1.600,00	19.679,61	12,11	12,28	12,44	26.697,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	31,58	2.700,00	85.258,46	30,86	31,41	31,70	28.332,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,60	7.600,00	103.368,15	13,49	13,71	14,39	23.759,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,61	1.600,00	21.779,42	13,49	13,71	14,39	23.759,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	16,75	1.000,00	16.750,55	16,60	16,77	16,92	6.627,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,20	22.200,00	70.993,65	3,16	3,20	3,25	36.907,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,21	4.300,00	86.911,82	20,10	20,23	20,50	10.461,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,64	5.100,00	54.239,12	10,56	10,64	10,76	34.886,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,39	3.800,00	54.693,77	13,74	14,31	14,57	31.158,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,39	19.000,00	273.464,98	13,74	14,31	14,57	31.158,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,93	2.500,00	89.820,40	35,54	35,96	36,32	80.702,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	39,29	300,00	11.786,68	38,82	39,23	39,94	27.072,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,12	9.600,00	183.549,64	18,86	19,28	19,72	47.361,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,06	2.800,00	53.379,43	18,86	19,28	19,72	47.361,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,99	11.100,00	199.703,14	17,60	17,87	18,43	23.399,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,04	3.100,00	31.126,72	9,75	10,07	10,66	16.739,00
08-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,97	6.500,00	64.805,00	9,75	10,07	10,66	16.739,00
08-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	AIEC11	44,18	2.839,00	125.427,02	44,18	44,31	44,99	1.508,00
08-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	79,76	4.457,00	355.476,41	79,16	79,68	80,14	2.601,00
08-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GARE11	9,06	110.000,00	996.377,43	9,03	9,05	9,10	29.730,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,74	2.600,00	56.523,31	21,51	21,72	21,85	9.916,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,79	1.700,00	11.540,35	6,49	6,81	7,01	9.093,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,97	20.200,00	140.697,82	6,84	6,97	7,10	26.636,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	40,24	1.900,00	76.450,14	39,41	40,26	40,79	7.883,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,03	900,00	23.425,65	25,95	26,01	26,10	27.935,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,36	600,00	20.617,59	34,15	34,34	34,55	8.756,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,16	1.300,00	43.104,68	32,18	33,10	33,64	23.532,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,36	400,00	3.342,81	8,28	8,37	8,41	8.037,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,34	100,00	833,61	8,28	8,37	8,41	8.037,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,32	1.700,00	20.936,70	12,20	12,32	12,41	13.408,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,34	4.500,00	55.519,17	12,20	12,32	12,41	13.408,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	41,39	3.400,00	140.741,54	40,85	41,34	41,76	12.817,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	41,20	1.800,00	74.159,03	40,85	41,34	41,76	12.817,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	31,45	3.800,00	119.497,68	31,25	31,40	31,52	17.402,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,98	1.400,00	19.566,10	13,53	13,90	14,07	8.384,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,68	1.200,00	20.016,37	16,55	16,67	16,76	5.342,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	16,65	300,00	4.995,00	16,55	16,67	16,76	5.342,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,16	6.500,00	20.542,71	3,11	3,15	3,22	22.952,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,14	1.300,00	4.082,00	3,11	3,15	3,22	22.952,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,66	3.600,00	38.364,66	10,60	10,65	10,70	24.052,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,20	3.000,00	42.596,80	14,04	14,23	14,56	16.705,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	36,27	500,00	18.135,60	35,90	36,23	36,42	56.656,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	39,35	3.300,00	129.869,84	38,58	39,35	39,73	24.024,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,59	5.300,00	103.843,08	19,21	19,59	19,82	18.228,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,27	8.800,00	160.807,69	17,80	18,28	18,49	14.941,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,36	1.000,00	18.362,91	17,80	18,28	18,49	14.941,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,04	3.600,00	151.340,66	40,72	41,90	42,57	33.086,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	20,23	3.200,00	64.738,35	20,08	20,72	21,07	10.657,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,12	1.900,00	110.429,71	57,86	58,19	59,05	15.017,00
11-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,73	1.800,00	19.313,95	10,17	10,66	11,00	12.287,00
11-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GARE11	8,99	88.966,00	799.996,82	8,95	8,98	9,02	23.416,00
12-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	SBS3P	93,13	2.200,00	204.886,48	92,13	94,79	96,08	31.114,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	58,11	2.800,00	162.712,73	57,20	57,63	58,59	58.944,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,62	1.200,00	25.941,06	21,52	21,62	21,84	10.878,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,79	500,00	3.394,17	6,67	6,76	6,84	4.973,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,21	4.900,00	35.348,47	7,00	7,18	7,28	32.305,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,23	1.000,00	7.232,32	7,00	7,18	7,28	32.305,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	39,81	400,00	15.924,72	39,65	39,97	40,65	5.137,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	25,88	400,00	10.352,35	25,80	25,90	26,09	39.950,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	33,71	200,00	6.742,52	33,58	33,85	34,33	10.859,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,96	600,00	20.376,69	32,75	33,67	34,29	38.261,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,34	3.200,00	26.701,35	8,30	8,33	8,39	6.228,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,33	1.500,00	12.502,32	8,30	8,33	8,39	6.228,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,41	2.700,00	25.416,02	9,35	9,41	9,49	20.446,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,41	900,00	8.470,93	9,35	9,41	9,49	20.446,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,38	2.500,00	23.445,72	9,35	9,41	9,49	20.446,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,38	4.000,00	141.526,78	35,14	35,39	35,93	24.162,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,36	1.100,00	38.899,14	35,14	35,39	35,93	24.162,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,30	6.400,00	78.749,97	12,20	12,29	12,37	19.903,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,28	400,00	4.912,00	12,20	12,29	12,37	19.903,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,32	600,00	7.391,02	12,20	12,29	12,37	19.903,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	40,53	700,00	28.370,00	40,16	40,51	41,51	16.636,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	40,47	5.100,00	206.419,49	40,16	40,51	41,51	16.636,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	40,58	5.200,00	211.023,82	40,16	40,51	41,51	16.636,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	40,46	500,00	20.230,52	40,16	40,51	41,51	16.636,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,40	1.700,00	53.380,12	31,28	31,42	31,64	22.542,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,79	1.100,00	15.174,14	13,70	13,82	14,00	12.103,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,57	300,00	5.272,43	16,88	17,51	17,88	13.224,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,30	4.900,00	16.165,25	3,15	3,25	3,33	46.935,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,15	300,00	6.045,17	20,02	20,14	20,33	6.929,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,54	1.700,00	17.923,91	10,51	10,57	10,71	25.508,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,24	1.300,00	18.515,37	14,14	14,30	14,55	15.629,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	4,39	1.200,00	5.267,19	4,23	4,35	4,45	4.144,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	36,97	100,00	3.696,70	36,34	36,78	37,11	82.883,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	39,40	500,00	19.699,88	39,20	39,41	39,67	23.283,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,93	2.300,00	45.846,71	19,61	19,92	20,07	27.090,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,19	100,00	1.818,67	18,06	18,21	18,69	13.099,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	44,91	20.900,00	938.612,26	43,72	44,97	45,93	72.957,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	44,84	15.800,00	708.482,51	43,72	44,97	45,93	72.957,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	20,79	100,00	2.079,00	20,42	20,78	21,11	76,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,31	1.700,00	34.521,76	20,16	20,36	20,61	8.199,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	59,29	700,00	41.500,14	58,10	59,02	59,41	22.909,00
12-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,55	800,00	8.440,27	10,38	10,58	10,84	8.973,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	12,58	883,00	11.108,77	12,30	12,51	12,64	41.045,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALOS3	21,63	100,00	2.163,08	21,52	21,62	21,84	10.878,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASA13	7,21	271,00	1.953,94	7,00	7,18	7,28	32.305,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	10,31	1.103,00	11.372,00	10,07	10,21	10,35	44.579,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSA3	25,95	572,00	14.843,39	25,80	25,90	26,09	39.950,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD03	11,91	302,00	3.596,82	11,89	11,94	12,02	7.744,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD04	13,39	1.033,00	13.831,69	13,32	13,39	13,49	29.857,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BSE3	33,74	130,00	4.386,42	33,58	33,85	34,33	10.859,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	33,89	261,00	8.844,78	32,75	33,67	34,29	38.261,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAV3	15,75	92,00	1.449,36	15,75	16,05	16,35	11.150,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	24,96	160,00	3.993,00	24,08	24,74	25,03	18.697,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	11,87	201,00	2.385,80	11,78	11,87	12,02	11.198,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,36	380,00	4.317,04	11,31	11,41	11,57	32.788,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	5,55	232,00	1.287,85	5,54	5,60	5,79	15.563,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	32,48	30,00	974,50	32,15	32,38	32,53	7.355,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL6	9,36	340,00	3.182,40	9,35	9,41	9,49	20.446,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	11,36	230,00	2.612,79	11,27	11,35	11,63	22.271,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	11,08	140,00	1.551,33	11,02	11,10	11,35	14.261,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CXSE3	14,11	100,00	1.411,00	14,10	14,17	14,34	11.033,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	21,68	50,00	1.084,10	21,50	21,70	21,95	10.938,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	39,33	50,00	1.966,50	39,18	39,40	39,68	6.292,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	35,27	361,00	12.732,23	35,14	35,39	35,93	24.162,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	39,89	50,00	1.994,30	39,72	39,99	40,71	7.302,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	54,11	150,00	8.116,56	53,26	54,37	56,00	28.831,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	12,28	12.780,00	156.940,56	12,20	12,29	12,37	19.903,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	40,16	60,00	2.409,30	40,16	40,51	41,51	16.636,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQLT3	31,42	3.120,00	98.032,88	31,28	31,42	31,64	22.542,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZT3	14,33	90,00	1.289,49	14,10	14,28	14,56	10.844,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	13,89	101,00	1.402,94	13,70	13,82	14,00	12.103,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	19,69	252,00	4.961,04	19,62	19,81	20,31	25.999,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAL4	10,90	130,00	1.417,00	10,89	11,05	11,42	14.592,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	3,31	953,00	3.154,53	3,15	3,25	3,33	46.935,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	20,69	90,00	1.861,98	20,44	20,65	21,07	20.810,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	10,58	1.100,00	11.637,55	10,51	10,57	10,71	25.508,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	34,70	900,00	31.200,00	34,66	34,89	35,28	37.768,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBS53	35,70	231,00	8.245,80	35,35	35,71	36,07	27.986,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	20,45	151,00	3.087,99	20,18	20,42	20,70	14.987,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LEN3	16,72	190,00	3.176,92	16,52	16,62	16,91	20.690,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	24,54	60,00	1.472,12	24,31	24,49	24,69	12.226,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	14,28	170,00	2.426,96	14,14	14,30	14,55	15.629,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	39,52	491,00	19.405,82	39,12	39,59	39,88	17.743,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	36,93	880,00	32.497,85	36,34	36,78	37,11	82.883,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRI03	39,20	160,00	6.272,00	39,20	39,41	39,67	23.283,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	25,22	250,00	6.305,15	25,21	25,37	25,68	20.176,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	19,96	240,00	4.790,40	19,61	19,92	20,07	27.090,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	28,81	230,00	6.625,65	28,43	28,82	28,95	16.587,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	18,20	50,00	910,18	18,06	18,21	18,69	13.099,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	45,44	200,00	9.088,10	43,72	44,97	45,93	72.957,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	26,14	70,00	1.829,81	26,14	26,27	26,52	11.505,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBS3	95,55	140,00	13.377,00	92,13	94,79	96,08	31.114,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	STBP3	12,82	171,00	2.192,40	12,69	12,75	12,83	7.430,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	59,35	122,00	7.240,85	58,10	59,02	59,41	22.909,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAEI11	34,11	40,00	1.364,30	34,00	34,28	34,66	10.717,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	16,54	161,00	2.662,82	16,34	16,50	16,58	16.525,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	29,96	110,00	3.295,59	29,70	30,00	30,38	12.994,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TRPL4	24,10	80,00	1.928,36	24,04	24,23	24,54	10.980,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	20,43	221,00	4.515,12	20,15	20,39	20,64	14.585,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	57,32	860,00	49.295,48	57,20	57,63	58,59	58.944,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	22,43	211,00	4.733,72	22,35	22,46	22,63	14.575,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	52,27	92,00	4.809,20	52,01	52,37	53,20	12.977,00
12-11-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	55,42	251,00	13.909,92	55,00	55,25	55,47	17.706,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASA13	7,01	10.200,00	71.464,32	6,90	7,04	7,26	32.589,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,81	4.600,00	155.519,43	33,38	33,76	34,08	26.537,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	8,26	1.300,00	10.734,23	8,22	8,31	8,41	4.694,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,31	1.000,00	9.312,76	9,26	9,31	9,42	14.565,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,01	7.300,00	87.652,00	11,83	12,03	12,33	28.244,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,05	4.400,00	53.018,89	11,83	12,03	12,33	28.244,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,05	6.100,00	73.480,60	11,83	12,03	12,33	28.244,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	40,93	1.300,00	53.206,08	40,37	40,91	41,37	19.346,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,26	38.300,00	124.745,81	3,02	3,17	3,37	59.644,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,99	2.500,00	49.972,63	19,86	20,01	20,28	9.612,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,47	25.300,00	264.834,16	10,39	10,46	10,57	25.375,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	45,05	7.100,00	319.824,38	44,41	45,10	46,20	39.421,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,20	3.300,00	73.272,77	21,98	22,20	22,53	23.617,00
13-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,05	6.300,00	138.915,00	21,98	22,20	22,53	23.617,00
13-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GARE11	9,02	27.725,00	250.002,44	8,99	9,01	9,04	23.677,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,99	600,00	13.196,59	21,62	21,96	22,20	9.301,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,05	9.600,00	67.699,28	6,94	7,04	7,17	19.918,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,11	6.300,00	214.922,22	33,55	34,12	34,31	20.123,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	9,57	1.900,00	18.188,97	9,35	9,56	9,64	21.790,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,75	500,00	17.873,67	35,40	35,76	35,94	22.843,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	41,77	300,00	12.531,75	40,89	41,68	41,89	12.730,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,66	800,00	26.124,91	31,38	32,52	32,83	35.248,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,21	1.100,00	22.231,33	20,06	20,49	20,64	4.963,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,80	300,00	11.939,93	39,17	39,70	39,99	20.974,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,00	1.200,00	23.994,47	19,83	20,09	20,55	32.071,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	44,69	400,00	17.876,00	43,94	44,80	45,81	36.880,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,86	5.200,00	103.293,47	19,77	19,89	20,41	8.414,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,58	300,00	18.174,00	59,47	60,45	60,89	21.743,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,15	3.200,00	70.880,00	22,04	22,60	22,60	24.438,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,21	6.700,00	148.790,31	22,04	22,20	22,60	24.438,00
14-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,08	2.200,00	48.576,00	22,04	22,20	22,60	24.438,00
18-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,05	1.200,00	8.460,65	6,92	7,07	7,19	28.167,00
18-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,00	54.300,00	163.132,91	2,95	3,03	3,17	42.687,00
18-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,86	2.500,00	49.646,76	19,72	19,92	20,17	8.111,00
18-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,60	3.200,00	62.734,60	19,49	19,59	19,95	10.427,00
18-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,87	1.100,00	24.053,52	21,75	21,86	22,32	26.221,00
18-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,88	4.700,00	102.827,26	21,75	21,86	22,32	26.221,00
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,59	500,00	10.796,11			21,68	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,11	10.100,00	71.777,36			6,97	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	41,63	400,00	16.651,41			41,18	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,14	3.600,00	122.895,14			34,13	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,15	600,00	20.488,80			34,13	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,07	2.600,00	88.580,06			34,13	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	8,54	2.000,00	17.083,33	8,40	8,55	8,76	10.204,00
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	9,56	1.200,00	11.474,78			9,57	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,64	600,00	21.386,46			35,63	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	41,83	300,00	12.549,41			41,96	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	33,00	2.100,00	69.297,75			33,12	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,97	2.400,00	79.128,00			33,12	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,85	800,00	26.278,97			33,12	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,76	1.100,00	15.131,52			13,85	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	17,87	1.200,00	21.448,49	17,71	17,88	17,97	5.129,00
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	17,89	1.800,00	32.202,00	17,71	17,88	17,97	5.129,00
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,07	1.200,00	24.078,58			20,18	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,39	1.300,00	13.513,25			10,40	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,40	4.200,00	60.480,00			14,29	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,15	1.300,00	18.388,65			14,29	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,67	300,00	11.901,57			39,77	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,31	1.100,00	22.340,93			20,41	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	43,70	400,00	17.478,11			43,89	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,94	1.500,00	29.906,58	19,46	19,90	20,07	9.684,00
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,56	400,00	24.224,29			60,40	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,83	5.500,00	120.063,75			21,80	
19-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	8,57	6.019,00	51.581,45	8,40	8,55	8,76	10.204,00
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,57	2.204,00	21.092,28			9,57	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,56	1.355,00	12.953,80			9,57	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,55	5.305,00	50.687,28			9,57	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,56	16.835,00	160.996,22			9,57	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	32,83	6.967,00	228.717,59			33,12	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	32,77	2.037,00	66.750,22			33,12	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	34,63	16.858,00	583.744,89			34,61	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,26	2.594,00	52.548,50			20,41	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,30	2.199,00	44.642,40			20,41	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,81	7.798,00	170.079,30			21,80	
19-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,83	28.110,00	613.596,92			21,80	
19-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,65	27.369,00	99.983,59	3,61	3,65	3,70	1.962,00
21-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	12,43	22.500,00	279.739,35			12,39	
21-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	9,86	28.600,00	281.977,76			9,82	
21-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	11,62	23.000,00	267.365,00			11,59	
21-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENEV3	11,77	52.600,00	619.329,38			11,78	
21-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT1	0,18	2.473,00	453,04	0,13	0,17	0,22	255,00
21-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	2,90	188.088,00	545.941,23			2,88	
21-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	37,93	4.200,00	159.317,00			37,91	
21-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	12,88	37.800,00	486.760,31			12,88	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,09	700,00	14.760,71			21,08	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,84	5.000,00	34.186,49			6,94	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	39,92	600,00	23.954,24			39,81	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	25,37	700,00	17.762,10			25,26	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,63	400,00	13.452,91			33,48	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,32	3.700,00	123.267,60			33,19	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	8,40	1.300,00	10.922,36	8,35	8,40	8,62	10.569,00
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,36	1.300,00	12.165,66			9,34	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,05	1.300,00	45.562,49			35,12	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,65	4.900,00	57.064,30			11,78	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	41,48	1.000,00	41.479,37			41,00	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,68	2.200,00	71.898,43			32,50	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	17,60	700,00	12.321,56	17,44	17,58	17,91	4.637,00
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,92	22.600,00	65.988,14			2,88	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,23	400,00	4.092,33			10,21	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,25	1.800,00	18.450,00			10,21	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,40	400,00	15.759,47			39,13	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,95	1.400,00	27.929,37			19,91	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	43,44	500,00	21.721,50			43,54	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,65	1.400,00	27.507,89	19,53		19,64	5.090,00
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,82	1.700,00	103.398,12			60,79	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,77	500,00	30.384,51			60,79	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,55	1.700,00	36.635,00			21,50	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,48	10.400,00	223.360,25			21,50	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,40	1.800,00	38.517,71			21,50	
21-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,98	1.300,00	12.969,94			10,01	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,45	8.762,00	74.052,26	8,35		8,40	10.569,00
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,41	13.916,00	117.065,48	8,35		8,40	10.569,00
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,39	5.863,00	55.053,57			9,34	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,38	5.288,00	49.601,44			9,34	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,42	6.640,00	62.548,80			9,34	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,43	604,00	5.695,72			9,34	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,54	2.189,00	47.150,69			21,50	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,46	1.491,00	31.991,68			21,50	
21-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,47	2.879,00	61.808,43			21,50	
22-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	39,43	14.300,00	563.900,88	38,47		39,83	86.485,00
22-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	40,24	8.500,00	342.051,73	39,09		39,84	26.776,00
22-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	58,06	3.300,00	191.610,04	57,25		57,93	31.751,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,28	2.000,00	42.565,72	20,92		21,33	21.500,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,68	3.600,00	24.062,95	6,63		6,73	4.778,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASA13	7,07	2.200,00	15.562,67	6,94		7,12	27.242,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	40,43	700,00	28.299,86	39,66		40,84	5.766,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	25,41	700,00	17.787,41	25,22		25,41	32.753,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSÉ3	33,68	400,00	13.470,00	33,51		33,73	10.684,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,17	1.000,00	33.171,60	32,87		33,18	16.437,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,29	3.600,00	29.842,14	8,26		8,31	11.924,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,29	2.000,00	18.579,50	9,25		9,32	13.004,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,06	1.900,00	66.607,57	34,88		35,09	18.112,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,02	1.500,00	18.025,76	11,79		11,97	24.267,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	41,72	900,00	37.543,83	41,08		41,58	13.425,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,61	3.000,00	97.833,90	32,39		32,58	20.915,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,48	2.700,00	36.394,93	13,41		13,51	7.337,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	17,39	900,00	15.651,77	17,21		17,40	5.494,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,93	600,00	1.760,11	2,88		2,93	45.440,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,13	4.800,00	96.605,46	19,66		20,33	9.367,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,19	1.700,00	17.328,42	10,16		10,20	20.652,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,20	2.500,00	25.491,10	10,16		10,20	20.652,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,14	2.000,00	28.285,78	13,88		14,12	14.916,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	39,39	400,00	15.756,63	38,47		39,21	86.485,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	40,30	1.100,00	44.333,80	39,09		39,84	26.776,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,09	4.100,00	82.368,17	19,93		20,08	23.061,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	43,80	1.400,00	61.325,80	43,08		43,76	26.592,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,85	600,00	11.910,48	19,52		20,00	5.084,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,79	1.500,00	91.186,46	60,31		60,69	16.950,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,55	100,00	2.154,72	21,38		21,56	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,45	21.200,00	454.670,83	21,38		21,56	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,56	2.700,00	58.213,98	21,38		21,83	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,51	14.500,00	311.844,53	21,38		21,83	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,05	1.400,00	14.063,06	9,91		10,06	9.683,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,29	1.124,00	9.320,93	8,26		8,31	11.924,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,29	2.249,00	18.651,92	8,26		8,31	11.924,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,30	8.218,00	68.247,49	8,26		8,31	11.924,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,27	4.530,00	42.004,18	9,25		9,32	13.004,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,28	16.343,00	151.709,75	9,25		9,32	13.004,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	32,56	8.944,00	291.177,45	32,39		32,58	20.915,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	34,06	8.566,00	291.792,57	33,94		34,08	27.239,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,67	4.908,00	106.347,23	21,38		21,56	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,54	7.915,00	170.528,49	21,38		21,83	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,52	30.497,00	656.185,49	21,38		21,83	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,59	2.799,00	60.436,29	21,38		21,56	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,58	3.733,00	80.564,94	21,38		21,83	18.249,00
22-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,51	3.040,00	65.394,57	21,38		21,83	18.249,00
22-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GARÉ11	9,08	16.521,00	149.997,69	9,05		9,07	27.173,00
25-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	11,59	14.200,00	164.549,23	11,49		11,78	27.420,00
25-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	42,14	4.400,00	185.414,04	41,68		41,94	13.492,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,48	900,00	19.331,52	21,11		21,42	12.169,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	41,45	400,00	16.581,00	40,82		41,56	7.997,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,31	400,00	13.324,34	32,87		33,16	14.412,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,55	1.600,00	13.674,30	8,36		8,51	10.045,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,62	1.800,00	17.308,93	9,34		9,59	23.951,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,82	900,00	32.235,41	35,16		35,65	20.646,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	41,89	400,00	16.756,74	41,68		41,94	13.492,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	33,04	1.200,00	39.645,68	32,74		33,01	24.420,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,97	800,00	11.176,66	13,54		13,87	14.116,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,73	1.800,00	37.313,25	20,27		20,58	8.119,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,22	27.700,00	283.166,86	10,18		10,21	32.437,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,23	5.600,00	57.285,11	10,18		10,21	32.437,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,36	8.600,00	123.511,14	14,18		14,40	18.482,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,41	1.000,00	14.405,56	14,18		14,40	18.482,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	39,35	5.200,00	204.636,55	39,15		39,34	39.866,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	40,04	400,00	16.017,10	39,85		40,04	17.003,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,32	1.800,00	36.582,22	20,12		20,32	27.512,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	43,77	600,00	26.262,97	43,53		43,64	26.758,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,12	600,00	36.071,92	59,87		60,06	25.667,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,82	3.400,00	74.177,94	21,70		21,81	16.779,00
25-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,82	4.300,00	93.835,92	21,70		21,81	16.779,00
25-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,50	11.639,00	98.892,04	8,36		8,51	10.045,00
25-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,62	11.222,00	107.923,41	9,34		9,59	23.951,00
25-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,53	31.345,00	298.693,87	9,34		9,59	23.951,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
25-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VB8R3	21,86	139,00	3.038,46	21,70	21,81	21,94	16.779,00
25-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VB8R3	21,82	12.600,00	274.980,22	21,70	21,81	21,94	16.779,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,89	700,00	15.324,09	21,21	21,73	22,00	16.724,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,77	6.300,00	137.181,45	21,21	21,73	22,00	16.724,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	7,89	6.600,00	52.067,42	7,47	7,82	7,97	40.392,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	42,91	1.000,00	42.913,66	41,45	42,76	43,27	10.136,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,99	10.500,00	94.380,76	8,78	8,97	9,09	10.057,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	10,15	26.200,00	265.812,85	9,89	10,12	10,27	25.976,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,43	700,00	25.504,06	35,82	36,35	36,59	29.216,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENG11	42,76	300,00	12.827,31	41,76	42,64	43,10	12.533,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,21	1.000,00	33.207,40	32,90	33,19	33,37	27.518,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,03	8.000,00	24.254,38	2,99	3,03	3,06	38.201,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,95	3.700,00	77.531,16	20,55	20,98	21,24	13.355,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,05	1.400,00	29.470,00	20,55	20,98	21,24	13.355,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,48	1.300,00	13.629,19	10,25	10,41	10,54	32.144,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,34	900,00	12.904,57	14,25	14,36	14,50	10.954,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	40,14	400,00	16.054,26	39,60	40,12	40,65	25.760,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,70	5.300,00	109.701,93	20,28	20,69	20,85	31.634,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	44,02	500,00	22.011,03	43,15	43,74	44,29	29.850,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	59,03	500,00	29.515,31	58,72	59,22	60,18	24.239,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	59,02	1.500,00	88.529,01	58,72	59,22	60,18	24.239,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VB8R3	22,17	3.100,00	68.737,04	21,76	22,15	22,40	16.410,00
26-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,04	106.860,00	324.846,86	2,99	3,03	3,06	38.201,00
26-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,03	36.748,00	111.509,65	2,99	3,03	3,06	38.201,00
26-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	34,82	13.039,00	454.066,46	34,17	34,77	35,16	44.739,00
27-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	24,38	4.700,00	114.584,99	24,30	24,50	24,75	17.156,00
27-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	16,73	12.000,00	200.755,40	16,02	16,37	17,04	5.967,00
27-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBFG3	13,51	6.200,00	83.748,49	13,25	13,53	13,94	8.908,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,40	3.900,00	83.448,90	20,96	21,21	21,89	20.003,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,50	1.600,00	34.399,44	20,96	21,21	21,89	20.003,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,85	4.700,00	32.207,91	6,75	6,90	7,26	7.282,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	39,64	1.300,00	51.531,37	39,01	40,02	43,10	10.446,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,90	18.200,00	52.868,45	2,85	2,95	3,08	76.427,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,04	2.900,00	61.016,00	20,19	20,66	21,26	14.687,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,83	2.100,00	43.748,90	20,19	20,66	21,26	14.687,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,90	10.600,00	157.921,71	13,84	14,65	15,25	36.575,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,28	8.600,00	174.440,98	20,17	20,25	20,83	44.056,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,71	4.700,00	92.631,18	19,24	19,68	20,82	15.921,00
27-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VB8R3	21,62	8.000,00	172.982,65	21,38	21,60	22,23	23.106,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	10,38	21.053,00	218.536,16	10,14	10,32	10,65	12.230,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,81	6.971,00	61.399,21	8,73	8,81	9,06	14.323,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,78	128,00	1.123,40	8,73	8,81	9,06	14.323,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,89	16.326,00	161.493,82	9,78	9,89	10,22	33.370,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,86	3.218,00	31.722,95	9,78	9,89	10,22	33.370,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,86	1.259,00	12.415,28	9,78	9,89	10,22	33.370,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBS3P	98,20	3.106,00	304.998,88	96,56	98,02	99,88	23.630,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBS3P	98,55	2.981,00	299.774,65	96,56	98,02	99,88	23.630,00
27-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBS3P	98,62	7.252,00	715.160,98	96,56	98,02	99,88	23.630,00
27-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	CEOC11	41,13	98,00	4.030,74	40,62	40,96	41,15	39,00
28-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	34,23	13.300,00	455.306,88	33,73	34,27	35,30	35.279,00
28-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	MRFG3	18,69	12.700,00	237.326,11	18,34	18,82	19,14	20.531,00
28-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	23,89	6.800,00	162.452,00	23,54	23,91	24,86	25.091,00
28-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBFG3	12,50	6.400,00	80.012,00	12,25	12,65	13,43	5.061,00
28-11-24	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	27,94	3.500,00	97.790,00	27,53	27,82	28,70	12.066,00
28-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	58,50	15.400,00	900.891,13	57,27	58,11	58,80	48.443,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	20,05	4.900,00	98.260,84	19,87	20,14	21,01	21.035,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,38	17.800,00	113.548,64	6,22	6,42	6,87	9.403,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,47	14.800,00	95.789,94	6,22	6,42	6,87	9.403,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	6,87	2.800,00	19.222,46	6,71	6,96	7,44	46.168,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	36,58	2.500,00	91.439,31	35,28	36,50	39,18	16.633,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBA33	24,65	700,00	17.256,31	24,41	24,71	25,21	55.138,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,51	500,00	16.756,67	33,26	33,45	33,77	13.455,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,96	400,00	12.384,63	30,51	30,95	31,84	29.211,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,64	2.100,00	18.133,92	8,54	8,63	8,75	8.232,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,65	3.200,00	27.694,46	8,54	8,63	8,75	8.232,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,71	3.700,00	35.929,03	9,55	9,69	9,84	23.867,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,74	3.800,00	37.024,47	9,55	9,69	9,84	23.867,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,48	4.500,00	51.667,86	11,35	11,49	11,70	35.609,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,32	6.600,00	87.935,46	13,17	13,35	13,65	12.570,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,35	1.300,00	17.355,00	13,17	13,35	13,65	12.570,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,35	2.500,00	33.384,79	13,17	13,35	13,65	12.570,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,36	1.200,00	16.026,32	13,17	13,35	13,65	12.570,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	16,27	900,00	14.645,50	16,07	16,25	17,04	12.261,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,77	37.500,00	103.954,45	2,70	2,77	2,88	41.260,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,82	3.600,00	35.355,74	9,72	9,86	10,08	34.483,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,01	2.100,00	29.413,02	13,56	14,03	14,70	34.733,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,85	1.100,00	43.836,49	39,25	39,87	40,32	23.984,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,39	800,00	13.113,09	16,15	16,40	16,78	5.852,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,35	1.100,00	20.185,00	18,32	18,48	19,21	17.369,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,54	2.300,00	42.652,38	18,32	18,48	19,21	17.369,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,45	1.500,00	92.177,91	59,40	61,36	61,98	40.156,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,54	1.300,00	80.001,89	59,40	61,36	61,98	40.156,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VB8R3	20,58	9.500,00	195.526,92	20,20	20,59	21,43	29.562,00
28-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,39	1.500,00	14.083,35	9,28	9,53	10,05	14.406,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,66	1.251,00	10.833,66	8,54	8,63	8,75	8.232,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,79	1.213,00	11.874,44	9,55	9,69	9,84	23.867,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,13	76,00	9,88	0,09	0,11	0,14	181,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	38,97	15.985,00	622.995,84	38,10	39,00	41,32	64.423,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	39,01	3.945,00	153.885,48	38,10	39,00	41,32	64.423,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	38,97	1.930,00	75.211,28	38,10	39,00	41,32	64.423,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBS3P	94,58	1.491,00	141.015,11	93,42	94,62	96,82	26.225,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBS3P	94,61	1.586,00	150.046,99	93,42	94,62	96,82	26.225,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2024 À 29 DE NOVEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	Sbsp3	94,59	3.852,00	364.351,07	93,42	94,62	96,82	26.225,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	Sbsp3	94,71	398,00	37.694,58	93,42	94,62	96,82	26.225,00
28-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	Sbsp3	94,64	291,00	27.541,52	93,42	94,62	96,82	26.225,00
28-11-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	NEWL11	106,04	124,00	13.149,04	105,25	105,69	106,49	77,00
29-11-24	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	36,92	6.600,00	243.672,00	36,49	37,30	38,78	88.488,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,24	11.400,00	219.343,79	18,94	19,38	19,79	36.812,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,10	5.800,00	35.365,47	5,99	6,12	6,34	13.248,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,02	11.400,00	68.628,00	5,99	6,12	6,34	13.248,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,06	800,00	4.847,63	5,99	6,12	6,34	13.248,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,06	7.300,00	44.264,55	5,99	6,12	6,34	13.248,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,05	3.100,00	18.755,00	5,99	6,12	6,34	13.248,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	24,66	1.100,00	27.122,18	24,32	24,57	24,84	44.041,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,41	700,00	23.386,27	33,26	33,41	33,59	12.974,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,42	1.500,00	50.122,91	33,26	33,41	33,59	12.974,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,19	1.200,00	36.228,53	29,74	30,15	30,94	55.254,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,69	5.700,00	49.531,76	8,48	8,59	8,77	11.120,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,70	6.400,00	62.082,95	9,55	9,67	9,78	23.708,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,70	10.400,00	100.864,92	9,55	9,67	9,78	23.708,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,21	3.700,00	126.585,18	33,42	34,02	34,58	33.142,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,46	1.900,00	21.781,45	11,24	11,46	11,65	25.907,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	40,13	1.000,00	40.129,65	39,15	39,90	40,59	26.471,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	30,51	2.200,00	67.115,30	29,78	30,35	31,01	62.121,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,11	14.000,00	183.536,99	12,94	13,10	13,35	16.293,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,00	5.100,00	66.300,00	12,94	13,10	13,35	16.293,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,02	2.200,00	28.641,82	12,94	13,10	13,35	16.293,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,03	1.500,00	19.540,12	12,94	13,10	13,35	16.293,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	16,03	1.300,00	20.839,87	15,80	16,06	16,31	14.273,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,64	19.500,00	51.480,00	2,59	2,66	2,76	100.736,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,66	58.000,00	154.284,09	2,59	2,66	2,76	100.736,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,67	113.200,00	302.054,19	2,59	2,66	2,76	100.736,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	19,01	8.100,00	153.987,44	18,51	18,92	19,20	25.705,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,72	13.500,00	131.223,91	9,58	9,71	9,81	44.205,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,37	2.200,00	29.422,96	13,07	13,49	13,94	32.929,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	38,90	500,00	19.447,50	38,41	38,87	39,22	56.649,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,97	1.700,00	67.950,75	38,78	39,85	40,29	36.131,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	37,13	9.900,00	367.567,35	36,49	37,30	38,78	88.488,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	37,88	800,00	30.302,95	36,49	37,30	38,78	88.488,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	37,58	700,00	26.305,85	36,49	37,30	38,78	88.488,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	20,34	100,00	2.033,71	20,15	20,40	20,69	123,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,13	900,00	16.314,59	17,65	18,11	18,48	22.251,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,04	7.400,00	133.519,45	17,65	18,11	18,48	22.251,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,18	2.100,00	130.578,62	61,66	62,36	63,30	47.360,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,21	6.500,00	404.361,71	61,66	62,36	63,30	47.360,00
29-11-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	20,41	2.900,00	59.194,35	20,04	20,48	20,76	24.548,00
29-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,09	6,00	0,54	0,07	0,09	0,11	104,00
29-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,62	3.968,00	93.730,60	22,65	23,37	23,91	31.656,00
29-11-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	37,42	5.065,00	189.510,90	36,49	37,30	38,78	88.488,00
29-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	34,58	8.109,00	280.436,48	20,04	20,48	20,76	24.548,00
29-11-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,42	5.623,00	114.821,66	20,04	20,48	20,76	24.548,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

Para o acompanhamento da rentabilidade dos investimentos dos Planos que administra, a EMBRAER PREV adotará a variação do valor da cota do Plano, dos segmentos de aplicação e dos fundos de investimentos e/ou carteiras onde o(s) Plano(s) aplica(m) seus recursos. A periodicidade da avaliação será no mínimo, mensal, com foco no resultado do semestre e ano. A rentabilidade dos segmentos, fundos de investimentos e/ou carteiras deve ser monitorada e comparada com indicadores de mercado e índices de referência definidos na Política de Investimento dos respectivos Planos.

Mensalmente são disponibilizados no portal da Entidade, www.embraerprev.com.br, os seguintes relatórios:

- 7.1. **Composição da Carteira de Investimentos:** Indica a composição da carteira de investimento da EMBRAER PREV, por segmento de aplicação (Renda Fixa, Renda Variável ou outros), bem como todos os títulos, ações e outros investimentos que sejam realizados pela Entidade.
- 7.2. **Rentabilidade e Resultados dos Investimentos:** Apresenta os principais resultados da administração da EMBRAER PREV e do Plano Embraer Prev, tais como fatos relevantes, benefícios concedidos, inscrições de novos Participantes, estatísticas de atendimento, rentabilidade dos investimentos e evolução patrimonial.

8. GLOSSÁRIO

Administrador

Atividade profissional aprovada pelos órgãos governamentais competentes para a administração de fundos e carteiras de investimentos. Nessa atividade, o administrador realiza a contabilização de ativos e passivos e todas as demais atividades correlatas para o bom funcionamento de um fundo ou carteira de investimentos.

Carteira

Conjunto composto por títulos, ações e contratos. A título de exemplo, a carteira de investimentos da EMBRAER PREV compõe-se de todos os investimentos vinculados aos Planos que a Entidade administra.

Dados Gerais

Compõem-se dos indicadores de risco de mercado, considerando os parâmetros definidos para seu cálculo e a composição dos investimentos de cada carteira ou fundo, como por exemplo: *Var (Value at Risk)* sobre o PL (Patrimônio Líquido), *ETL (Expected Tail Loss)* sobre o PL (Patrimônio Líquido) e o *Var (Value at Risk)* sobre a variação do CDI.

Vide também glossário de *Value at Risk*, Patrimônio Líquido e *Expected Tail Loss*.

Duration

É o cálculo do prazo médio de vencimento de um título, fundo ou carteira, ajustado pelo fluxo de recebimento de juros e do valor principal, calculado pelo seu valor presente.

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

Expressão em inglês, também chamada de “Risco de Cauda”, que representa o cálculo de probabilidade de perdas de um título, fora do intervalo de confiança determinado como parâmetro.

Fundo de Investimento

É um tipo de aplicação financeira que reúne recursos de um conjunto de investidores, regido por um regulamento, destinado à aplicação em títulos, valores mobiliários ou em quaisquer outros ativos disponíveis no mercado financeiro e de capitais.

Índice de Referência (*Benchmark*)

Indicador usado para comparar a rentabilidade entre investimentos, produtos, serviços e taxas. No mercado de ações, por exemplo, o índice BOVESPA é o *benchmark* mais utilizado.

LDI (*Liability Driven Investments*)

É uma técnica de construção de carteira de investimento para Planos de Aposentadoria, que busca imunizar os compromissos (pagamento de benefícios) do Plano, aumentando a segurança para o cumprimento desse objetivo.

Parâmetros do Cálculo do *VaR* (*Value at Risk*)

É a etapa inicial para o cálculo do Var, onde são definidos os métodos estatísticos e os elementos de análise do ativo, fundo ou carteira, para medir seu risco de mercado.

Patrimônio de Cobertura

É o total de recursos do Plano para cobertura de suas obrigações.

Patrimônio Líquido (PL)

Para fins de entendimento desse relatório, trata-se do somatório de todos os títulos e direitos de um fundo ou uma carteira de investimentos.

Rating

Expressão em inglês que significa classificação do risco oferecido por um banco, um fundo de investimento, uma empresa ou um país. Feito por agências especializadas, é utilizado como referência aos investidores na hora de decidirem onde aplicar os recursos. A classificação é expressa em termos de qualidade (excelente à péssima) ou nível de risco (grau de investimento à inadimplente). Entre as maiores agências, estão as norte-americanas *Standard & Poor's*, *Fitch IBA* e *Moody's Investors*.

Stress Testing

É uma simulação para avaliar o desempenho de um ativo, fundo ou carteira, sob um conjunto específico de condições adversas de mercado, que podem ser definidas pelo seu Administrador, nesse caso chamado de “cenário próprio”, ou pelo cenário disponibilizado pela BM&F Bovespa.

Tracking Error

Termo em inglês que define a diferença entre os retornos de uma carteira e o retorno do seu índice de referência (*benchmark*). É o desvio padrão da diferença calculada entre esses retornos.

Túnel de Preços

É o intervalo de preços estabelecido pelo administrador, que determina se a operação de compra ou venda de um determinado ativo foi realizada em condições de mercado, no momento daquela negociação.

Valor Presente

É o valor de uma série de fluxos de caixa futuros, descontados por uma taxa de juros (taxa de desconto).

Value at Risk (VaR)

Expressão em inglês para o cálculo de probabilidade de perdas de uma aplicação em vários cenários adversos da economia. Avalia a perda máxima que uma carteira poderá ter dentro de um horizonte e intervalo de confiança determinados.